

鹏华普天债券证券投资基金 2015 年半年 度报告摘要

2015 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 25 日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|----------------|
| 基金简称 | 鹏华普天债券 | |
| 场内简称 | - | |
| 基金主代码 | 160602 | |
| 系列基金名称 | 鹏华普天系列基金 | |
| 系列其他子基金名称 | 鹏华普天收益混合(160603) | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2003年7月12日 | |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 267,746,657.28份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 鹏华普天债券 A | 鹏华普天债券 B |
| 下属分级基金的交易代码: | 160602 | 160608 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 216,837,625.00份 | 50,909,032.28份 |

2.2 基金产品说明

| | | |
|---------------|---|----------|
| 投资目标 | 以分享中国经济成长和资本长期稳定增值为宗旨，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资产的长期稳定增值。 | |
| 投资策略 | 债券管理的风险因素依据其对超额收益的贡献大小依次分为久期、期限结构、类属配置和个券选择，我们针对每一类别的风险因素设计相应的管理方法即形成投资策略，依次为久期配置策略、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。 | |
| 业绩比较基准 | 中信标普国债指数涨跌幅×90%+金融同业存款利率×10% | |
| 风险收益特征 | 本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。 | |
| | 鹏华普天债券 A | 鹏华普天债券 B |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 风险收益特征同上 | 风险收益特征同上 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 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 |
| 客户服务电话 | 4006788999 | 95559 |

| | | |
|----|---------------|--------------|
| 传真 | 0755-82021126 | 021-62701216 |
|----|---------------|--------------|

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.phfund.com |
| 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 上海市仙霞路 18 号交通银行股份有限公司 |

§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

| 基金级别 | 鹏华普天债券 A | 鹏华普天债券 B |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日) | 报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 53,737,493.21 | 4,876,330.54 |
| 本期利润 | 36,249,699.32 | 2,864,506.94 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1074 | 0.0996 |
| 本期基金份额净值增长率 | 9.54% | 9.60% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015 年 6 月 30 日) | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2632 | 0.2155 |
| 期末基金资产净值 | 273,905,791.22 | 63,373,460.79 |
| 期末基金份额净值 | 1.263 | 1.245 |

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）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 | 0.24% | 0.47% | 0.19% | 0.28% | 0.05% | 0.19% |
| 过去三个月 | 6.31% | 0.42% | 1.79% | 0.22% | 4.52% | 0.20% |
| 过去六个月 | 9.54% | 0.41% | 2.34% | 0.17% | 7.20% | 0.24% |
| 过去一年 | 22.06% | 0.35% | 5.16% | 0.15% | 16.90% | 0.20% |
| 过去三年 | 26.83% | 0.22% | 10.22% | 0.11% | 16.61% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 101.04% | 0.25% | 42.44% | 0.11% | 58.60% | 0.14% |

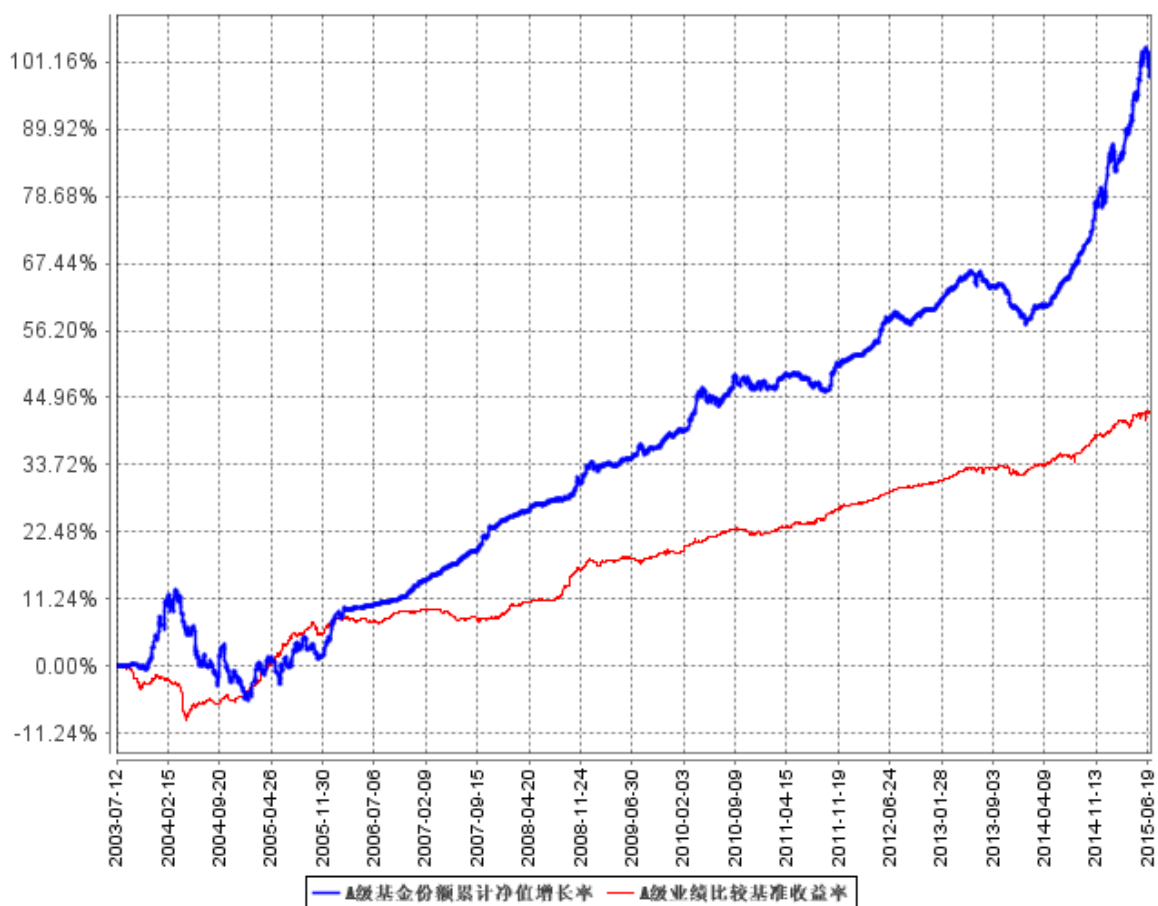
鹏华普天债券 B

| 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 | 0.16% | 0.48% | 0.19% | 0.28% | -0.03% | 0.20% |
| 过去三个月 | 6.41% | 0.42% | 1.79% | 0.22% | 4.62% | 0.20% |
| 过去六个月 | 9.60% | 0.41% | 2.34% | 0.17% | 7.26% | 0.24% |
| 过去一年 | 21.85% | 0.35% | 5.16% | 0.15% | 16.69% | 0.20% |
| 过去三年 | 25.55% | 0.22% | 10.22% | 0.11% | 15.33% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 91.18% | 0.25% | 42.44% | 0.11% | 48.74% | 0.14% |

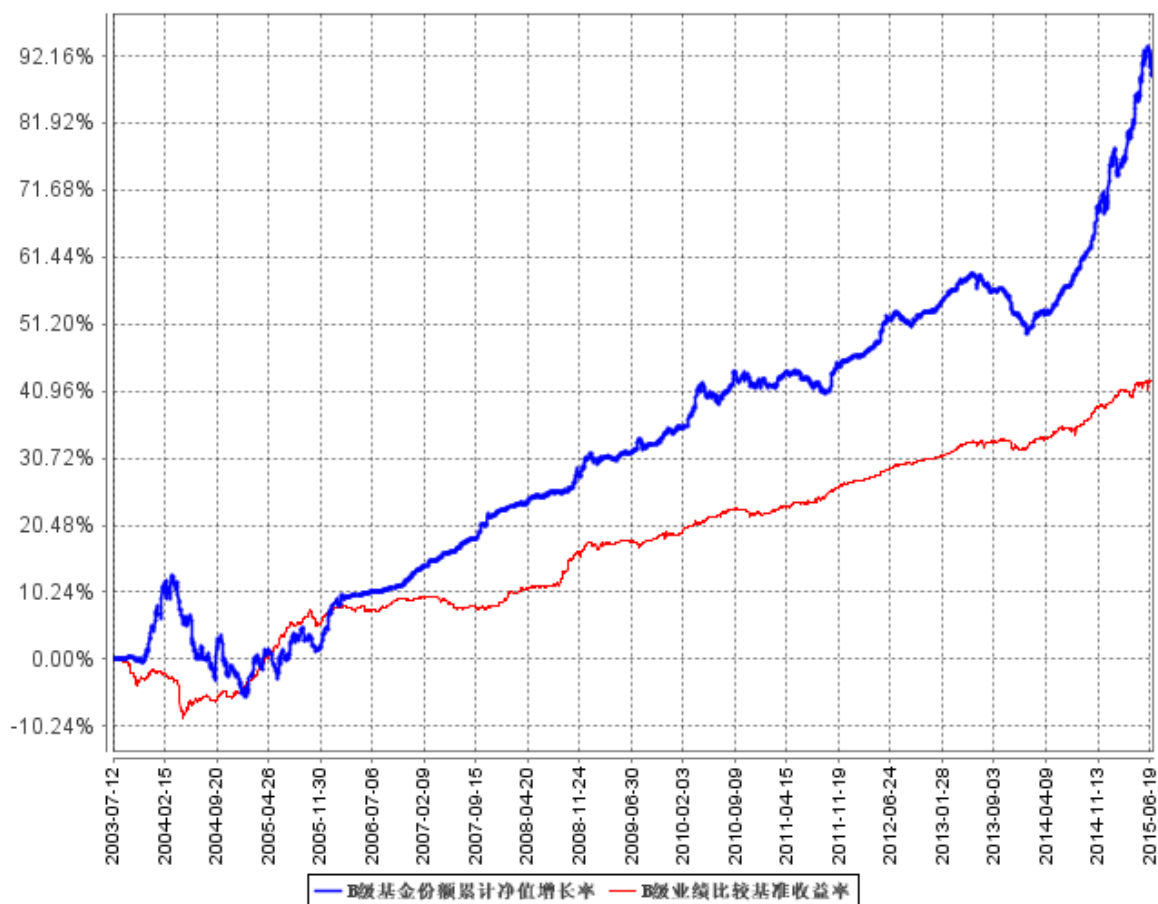
注：业绩比较基准=中信标普国债指数涨跌幅×90%+金融同业存款利率×10%。

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

A级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



B级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、本基金合同于 2003 年 7 月 12 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。

§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。截止本报告期末，公司管理资产总规模达到 3575.13 亿元，管理 81 只开放式基金、10 只全国社保投资组合。经过近 17 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 | | |
| 祝松 | 本基金基金经理 | 2014年2月 22日 | - | 9 | <p>祝松先生，国籍中国，经济学硕士，9年金融证券从业经验。曾任职于中国工商银行深圳市分行资金营运部，从事债券投资及理财产品组合投资管理；招商银行总行金融市场部，担任代客理财投资经理，从事人民币理财产品组合的投资管理工作。</p> <p>2014年1月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资管理工</p> <p>作，2014年2月至今担任鹏华普天债券基金基金经理，2014年</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | <p>2 月至今兼任鹏华丰润债券型证券投资基金基金经理，2014 年 3 月起兼任鹏华产业债债券型证券投资基金基金经理，2015 年 3 月起兼任鹏华双债加利债券型证券投资基金基金经理。祝松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。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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 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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年上半年我国债券市场整体延续小幅上涨走势，与去年末相比，上证国债指数上涨 2.72%，银行间中债综合财富指数上涨 3.11%。具体来看，债券收益率曲线趋于陡峭化，中短期债券利率明显下行，长期债券表现为区间震荡，这主要是由于一方面，经济低迷、通胀不高，货币政策延续宽松，基本面仍然对债市有利，尤其是在短端市场上；另一方面，股市资金分流、地方债供给压力、稳增长加力引发的经济企稳反弹预期则抑制了长债的上涨。

权益及可转债市场方面，股票市场在经历年初前两个月盘整走势后，三月份开始快速上行，但六月后半月出现大幅回调，上半年上证综指总体上涨 32.23%，可转债跟随正股呈现过山车走势。

报告期内本基金以持有中高评级信用债为主，债券组合久期保持在中等水平，此外对可转债等权益品种进行了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年上半年普天债券 A 份额净值增长率为 9.54%，高于基准 7.2%；普天债券 B 份额净值增长率为 9.6%，高于基准 7.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期内债券市场可能维持区间震荡格局，一方面，宽松货币政策延续，股市调整可能使部分资金回流债市，推动债券市场继续走好；另一方面，上半年稳增长政策逐渐发力，房地产销售持续好转，经济存在企稳反弹可能，可能使得长期债券利率水平进一步下降的空间受到抑制。中长期来看，我们对债券市场持谨慎乐观的态度，主要逻辑在于政府对经济是“托底”而非“强刺激”，政策发力后不排除短期经济企稳反弹的可能，但经济在中长期走强有赖于其内生动力的增强，

而这一风险尚未看到。

对于权益及可转债市场，我们持谨慎乐观的态度，一方面，经济结构转型仍然需要良好的资本市场环境，另一方面，短期内股市的大幅调整对市场各方均产生了较为明显的心理影响，我们倾向于认为下半年市场仍然面临一定的波动风险。

基于以上分析，下半年本基金将以中高评级信用债为主，维持中性久期，适当参与权益及转债市场波段操作，本基金将继续坚持稳健投资原则，以获取中长期收益为最主要目标。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

4.6.1.1 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.1.2 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度：

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和政策。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1 截止本报告期末，鹏华普天债券基金 A 可供分配利润为 57,068,166.22 元，期末基金份额净值 1.263 元；鹏华普天债券基金 B 可供分配利润为 10,968,875.90 元，期末基金份额净值 1.245 元。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

4.7.3 根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

4.8 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

2015 年上半年度，基金托管人在鹏华普天债券证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2015 年上半年度，鹏华基金管理有限公司在鹏华普天债券证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2015 年上半年度，由鹏华基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鹏华普天债券证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：鹏华普天债券证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 11,742,887.25 | 8,429,096.90 |
| 结算备付金 | 18,866,644.21 | 34,401,736.85 |
| 存出保证金 | 43,642.30 | 6,019.96 |
| 交易性金融资产 | 467,214,169.66 | 713,887,548.80 |
| 其中：股票投资 | 47,074,882.26 | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 420,139,287.40 | 713,887,548.80 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 3,286,696.38 |
| 应收利息 | 8,063,364.99 | 19,993,280.84 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 2,754,640.15 | 564,429.24 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 508,685,348.56 | 780,568,808.97 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 161,000,000.00 | 288,999,725.00 |
| 应付证券清算款 | 6,440,863.50 | 8,671,362.50 |
| 应付赎回款 | 2,886,469.63 | 411,147.43 |
| 应付管理人报酬 | 165,032.03 | 306,628.74 |
| 应付托管费 | 49,509.62 | 91,988.64 |
| 应付销售服务费 | 15,243.89 | 7,946.14 |
| 应付交易费用 | 103,064.48 | 127,911.66 |
| 应交税费 | 471,060.16 | 471,060.16 |
| 应付利息 | - | 64,202.88 |

| | | |
|---------------|----------------|----------------|
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 274,853.24 | 230,803.11 |
| 负债合计 | 171,406,096.55 | 299,382,776.26 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 267,746,657.28 | 417,597,460.63 |
| 未分配利润 | 69,532,594.73 | 63,588,572.08 |
| 所有者权益合计 | 337,279,252.01 | 481,186,032.71 |
| 负债和所有者权益总计 | 508,685,348.56 | 780,568,808.97 |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额总额 267,746,657.28 份，其中鹏华普天债券基金 A 类基金份额的份额总额为 216,837,625 份，份额净值 1.263 元，鹏华普天债券基金 B 类基金份额的份额总额为 50,909,032.28 份，份额净值 1.245 元。

6.2 利润表

会计主体：鹏华普天债券证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|-----|--|---|
| 一、收入 | | 43,769,078.58 | 32,073,488.95 |
| 1.利息收入 | | 18,291,058.21 | 24,769,185.59 |
| 其中：存款利息收入 | | 260,976.93 | 1,397,909.97 |
| 债券利息收入 | | 18,030,081.28 | 23,325,334.41 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 45,941.21 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 44,730,227.49 | -23,060,048.43 |
| 其中：股票投资收益 | | 10,099,615.45 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | 34,558,150.68 | -23,060,048.43 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | | 72,461.36 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -19,499,617.49 | 30,246,788.61 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | | 247,410.37 | 117,563.18 |
| 减：二、费用 | | 4,654,872.32 | 5,464,285.83 |

| | | | |
|---------------------|-----------|---------------|---------------|
| 1. 管理人报酬 | 6.4.8.2.1 | 1,310,350.81 | 2,214,166.87 |
| 2. 托管费 | 6.4.8.2.2 | 393,105.24 | 664,250.05 |
| 3. 销售服务费 | | 51,490.39 | 77,972.32 |
| 4. 交易费用 | | 191,529.61 | 130,889.39 |
| 5. 利息支出 | | 2,572,749.12 | 2,233,667.15 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,572,749.12 | 2,233,667.15 |
| 6. 其他费用 | | 135,647.15 | 143,340.05 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 39,114,206.26 | 26,609,203.12 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 39,114,206.26 | 26,609,203.12 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华普天债券证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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） | 417,597,460.63 | 63,588,572.08 | 481,186,032.71 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 39,114,206.26 | 39,114,206.26 |
| 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） | -149,850,803.35 | -33,170,183.61 | -183,020,986.96 |
| 其中：1.基金申购款 | 196,960,183.62 | 41,635,347.00 | 238,595,530.62 |
| 2.基金赎回款 | -346,810,986.97 | -74,805,530.61 | -421,616,517.58 |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 267,746,657.28 | 69,532,594.73 | 337,279,252.01 |

| 项目 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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) | 973,422,589.55 | 2,714,931.29 | 976,137,520.84 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | - | 26,609,203.12 | 26,609,203.12 |
| 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) | -278,022,322.64 | 423,848.74 | -277,598,473.90 |
| 其中：1.基金申购款 | 137,665,190.92 | 499,989.11 | 138,165,180.03 |
| 2.基金赎回款 | -415,687,513.56 | -76,140.37 | -415,763,653.93 |
| 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) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 695,400,266.91 | 29,747,983.15 | 725,148,250.06 |

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：

邓召明

高鹏

郝文高

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

鹏华普天系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 61 号《关于同意鹏华普天系列开放式证券投资基金设立的批复》核准,由鹏华基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 7 月 12 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设两个子基金,分别为普天债券投资基金(以下简称“本基金”)和普天收益证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认

购资金利息共募集 1,140,717,155.06 元，其中包括本基金 797,489,567.02 元和普天收益证券投资基金 343,227,588.04 元，经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 78 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金已按规定将《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》等法定文件报中国证监会备案。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》的有关规定，本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；具体投资于债券以及配售和增发的新股。在正常市场状况下，债券投资比例为 80%-95%，股票投资比例不高于 20%，现金或到期日在一年以内的政府债券不得低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中信标普国债指数涨跌幅×90%+金融同业存款利率×10%。

根据《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》和《鹏华普天系列开放式证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，自 2006 年 5 月 15 日起，本基金根据申购费用、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用的，称为 A 类；不收取申购费用、赎回费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金类别，称为 B 类。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

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》、《鹏华普天系列开放式证券投资基金基金合同》和中国证监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 2015 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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

本基金本报告期的会计估计发生变更。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会《中国

证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除以上会计估计的变更，本报告期所采用的其他会计政策、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

本报告期税项未发生变化。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”） | 基金托管人、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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比较期间未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

6.4.8.1 关联方报酬

6.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,310,350.81 | 2,214,166.87 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 76,621.37 | 113,560.21 |

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，2006 年 5 月 15 日之前的约定

年费率为 0.75%，自 2006 年 5 月 15 日普天债券基金分设 A、B 类份额起，管理人报酬年费率为 0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.6%÷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。

6.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 393,105.24 | 664,250.05 |

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的托管费，2006 年 5 月 15 日之前的约定年费率为 0.20%，自 2006 年 5 月 15 日普天债券基金分设 A、B 类份额起，托管费年费率为 0.18%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.18%÷当年天数。

6.4.8.1.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------------|-----------|-----------|
| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 鹏华普天债券 A | 鹏华普天债券 B | 合计 |
| 鹏华基金公司 | - | 26,233.46 | 26,233.46 |
| 交通银行 | - | 2,727.81 | 2,727.81 |
| 合计 | - | 28,961.27 | 28,961.27 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 鹏华普天债券 A | 鹏华普天债券 B | 合计 |
| 鹏华基金公司 | - | 65,507.37 | 65,507.37 |
| 交通银行 | - | 1,445.22 | 1,445.22 |
| 合计 | - | 66,952.59 | 66,952.59 |

注：自 2006 年 5 月 15 日普天债券基金分设 A、B 类份额起，支付基金销售机构的 B 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日计提，按月支付，A 类基金份额不收取销售服务费。日销售服务费=前一日基金资产净值×0.3%÷当年天数。

6.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
|---|---------------------------------------|----------|
| | 鹏华普天债券 A | 鹏华普天债券 B |
| 基金合同生效日（ 2003 年 7 月 12 日）持有的 基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 27,048,692.79 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 27,048,692.79 | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 12.4742% | - |

| 项目 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 | |
|---|--|----------|
| | 鹏华普天债券 A | 鹏华普天债券 B |
| 基金合同生效日（ 2003 年 7 月 12 日）持有的 基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 27,048,692.79 | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 27,048,692.79 | - |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 4.1873% | - |

注：本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.8.3.2 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。

6.4.8.4 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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 |
| 交通银行 | 11,742,887.25 | 50,608.92 | 1,437,146.61 | 103,369.32 |

6.4.8.5 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。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限股票及权证等其他证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金没有持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 161,000,000.00 元，于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§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 | 47,074,882.26 | 9.25 |
| | 其中：股票 | 47,074,882.26 | 9.25 |
| 2 | 固定收益投资 | 420,139,287.40 | 82.59 |
| | 其中：债券 | 420,139,287.40 | 82.59 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 30,609,531.46 | 6.02 |
| 7 | 其他各项资产 | 10,861,647.44 | 2.14 |
| 8 | 合计 | 508,685,348.56 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | - | - |
| C | 制造业 | 11,308,769.54 | 3.35 |
| 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 | 32,790,112.72 | 9.72 |
| K | 房地产业 | 2,976,000.00 | 0.88 |
| 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 | 47,074,882.26 | 13.96 |

7.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值 |
|----|------|------|-------|------|---------|
|----|------|------|-------|------|---------|

| | | | | | 比例 (%) |
|---|--------|------|-----------|---------------|--------|
| 1 | 600016 | 民生银行 | 1,882,788 | 18,714,912.72 | 5.55 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 130,000 | 10,652,200.00 | 3.16 |
| 3 | 600875 | 东方电气 | 300,000 | 6,141,000.00 | 1.82 |
| 4 | 601988 | 中国银行 | 700,000 | 3,423,000.00 | 1.01 |
| 5 | 600067 | 冠城大通 | 300,000 | 2,976,000.00 | 0.88 |
| 6 | 000425 | 徐工机械 | 200,000 | 2,654,000.00 | 0.79 |
| 7 | 002408 | 齐翔腾达 | 146,661 | 2,513,769.54 | 0.75 |

注：以上股票明细为本基金本报告期末持有的所有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 20,692,809.60 | 4.30 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 17,547,584.16 | 3.65 |
| 3 | 600875 | 东方电气 | 17,213,100.00 | 3.58 |
| 4 | 600067 | 冠城大通 | 5,653,237.66 | 1.17 |
| 5 | 000425 | 徐工机械 | 5,562,305.85 | 1.16 |
| 6 | 002408 | 齐翔腾达 | 5,283,093.84 | 1.10 |
| 7 | 601988 | 中国银行 | 5,255,148.75 | 1.09 |
| 8 | 600023 | 浙能电力 | 3,412,441.80 | 0.71 |

注：(1) 买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

(2) 以上为本报告期内买入的全部股票明细。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 600875 | 东方电气 | 16,707,280.34 | 3.47 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 13,940,359.60 | 2.90 |
| 3 | 000425 | 徐工机械 | 4,531,070.45 | 0.94 |
| 4 | 600023 | 浙能电力 | 3,508,702.56 | 0.73 |
| 5 | 600067 | 冠城大通 | 3,083,119.70 | 0.64 |

| | | | | |
|---|--------|------|--------------|------|
| 6 | 601988 | 中国银行 | 2,685,247.50 | 0.56 |
| 7 | 002408 | 齐翔腾达 | 2,341,572.80 | 0.49 |

注：（1）卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

（2）以上为本报告期内卖出的全部股票明细。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 80,619,721.66 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 46,797,352.95 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 80,832,000.00 | 23.97 |
| | 其中：政策性金融债 | 80,832,000.00 | 23.97 |
| 4 | 企业债券 | 332,408,465.50 | 98.56 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 6,898,821.90 | 2.05 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 420,139,287.40 | 124.57 |

7.6 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（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 110412 | 11 农发 12 | 400,000 | 40,616,000.00 | 12.04 |
| 2 | 150202 | 15 国开 02 | 400,000 | 40,216,000.00 | 11.92 |
| 3 | 124146 | 13 海发控 | 395,240 | 40,168,241.20 | 11.91 |
| 4 | 122181 | 12 山鹰债 | 350,000 | 36,396,500.00 | 10.79 |
| 5 | 1480272 | 14 柳州龙投债 | 300,000 | 33,063,000.00 | 9.80 |

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.10.1 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。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债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国债期货投资。

7.10.3 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。

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 | 43,642.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,063,364.99 |
| 5 | 应收申购款 | 2,754,640.15 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,861,647.44 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 113501 | 洛钼转债 | 5,968,032.00 | 1.77 |
| 2 | 113007 | 吉视转债 | 743,340.00 | 0.22 |

7.11.5 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。

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

| 份额级别 | 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 |
| 鹏华普天债券 A | 4,974 | 43,594.21 | 153,435,412.87 | 70.76% | 63,402,212.13 | 29.24% |
| 鹏华普天债券 B | 1,989 | 25,595.29 | 32,976,092.33 | 64.77% | 17,932,939.95 | 35.23% |
| 合计 | 6,963 | 38,452.77 | 186,411,505.20 | 69.62% | 81,335,152.08 | 30.38% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 鹏华普天债券 A | 1,417.37 | 0.0007% |
| | 鹏华普天债券 B | - | - |

| | | | |
|--|----|----------|---------|
| | 合计 | 1,417.37 | 0.0005% |
|--|----|----------|---------|

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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人及本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 鹏华普天债券 A | 鹏华普天债券 B |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2003 年 7 月 12 日）基金 份额总额 | 797,604,310.79 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 399,057,357.70 | 18,540,102.93 |
| 本报告期基金总申购份额 | 74,018,687.00 | 122,941,496.62 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 256,238,419.70 | 90,572,567.27 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列） | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 216,837,625.00 | 50,909,032.28 |

注：（1）总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

（2）本基金从 2006 年 5 月 15 日起分为 A、B 两级。

§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

10.2.1 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，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]217号文核准，公司聘任高永杰先生担任公司督察长，任职日期自 2015 年 2 月 6 日起。

报告期内经公司股东会审议通过，公司聘任陈冰女士担任公司监事，并自陈冰女士担任公司监事之日起，李国阳先生不再担任公司监事。陈冰女士任职日期自 2015 年 6 月 2 日起。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中信建投 | 1 | 39,924,709.70 | 85.31% | 103,128.65 | 75.16% | - |
| 长江证券 | 1 | 6,872,643.25 | 14.69% | 34,086.23 | 24.84% | - |

注：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，最近二年未因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。本报告期内交易单元未发生变化。

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 | |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
| | 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 |
| 中信建投 | 132,264,035.02 | 69.88% | 23,926,200,000.00 | 93.86% | - | - |
| 长江证券 | 57,002,024.87 | 30.12% | 1,565,782,000.00 | 6.14% | - | - |

鹏华基金管理有限公司
2015年8月25日