

(上接 C102 版)

基金管理人可根据有关法律法规要求,根据实际情况,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示。

登记机构名称:鹏华基金管理有限公司 住所:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层 法定代表人:何如 办公地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层 联系电话:(0755)18201877 传真:(0755)82011165 负责人:范伟强

三、出具法律意见书的律师事务所 名称:上海通海律师事务所 住所:上海市浦东新区浦东南路68号时代金融中心19楼 法定代表人:俞卫锋 办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼 联系电话:(021)31386600 传真:(021)31386000 联系人:陈丽华 经办律师:黎明、丁媛

四、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 法定代表人:李丹 办公地址:上海市湖滨路202号领展企业广场2楼普华永道中心11楼 联系电话:(021)23238888 传真:(021)23238800 联系人:魏佳佳 经办会计师:许康祺、陈燕

第四部分 基金的名称 本基金名称:鹏华基金灵活配置混合型证券投资基金 第五部分 基金的投资方式与类型 契约型开放式,保本混合证券投资基金 第六部分 基金的投资目标 本基金在科学、谨慎的资产配置基础上,精选股票、债券等投资标的,力争基金资产长期稳定增值。

第七部分 基金的投资范围 本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小创、创业板及其他经中国证监会核准上市的公司股票)、债券(含国债、金融债、企业债、可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债、资产支持证券等)、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

第八部分 基金的投资策略 本基金通过跟踪数量通常的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平及增长率、利率水平及走势等)及国际政策取向(包括财政、货币、税收、汇率政策等)来判断经济周期所处的位置及未来较大概率的发展方向,在此基础上对各大类资产的风险和预期收益进行综合分析,制定投资策略,发掘、挖掘大类资产之间的配置比例,调整资产配置和仓位。

第九部分 基金的风险收益特征 本基金属于混合型基金,其预期的风险收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中较高风险、中高预期收益的品种。

借款而言,通过业内比较、历史比较和成长性分析,确定具有上升基础的股票资产。 3.债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、调整策略等积极投资策略,自上而下地管理组合的久期,灵活地调整组合的券种搭配,同时精选个券,以增强组合的持有期收益。

(1)久期策略 久期管理是债券投资的重要考量因素,本基金将采用以“目标久期”为中心,自上而下的组合久期管理策略。 (2)收益率曲线策略 收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据,本基金将根据此调整组合中长、短期债券的搭配,并进行动态调整。

(3)骑乘策略 本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略,以达到增强组合的持有期收益的目的。 (4)息差策略 本基金将根据市场利率变化,通过调整久期来把握债券投资的收益目的。

(5)个券选择策略 本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合信用等级、流动性、选择权条款、期权等特征等因素,确定其投资价值,选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

(6)信用策略 本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价,根据内、外部信用评级结果,结合对类似债券信用利差的分析以及对未来利率走势的判断,选择信用利差被低估、未来信用利差可能扩大的债券进行投资。

第十部分 基金的风险收益特征 本基金属于混合型基金,其预期的风险收益高于货币市场基金、债券基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中较高风险、中高预期收益的品种。

第十一部分 基金的投资组合报告 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。 基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4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。

第十二部分 基金的投资组合报告 截至本报告期末2019年1月1日起至2019年3月31日止, 1.报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(人民币元), 占基金总资产的比例(%)

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

Table with 3 columns: 代码, 名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

4.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

Table with 5 columns: 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(%)

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资产投资明细

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 注: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 注: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五名权证投资明细 注:无。 9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:无。 10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 注:无。 11.投资组合报告附注

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。

第十二部分 基金的费用与税收 一、基金费用的种类 1.基金管理人的管理费; 2.基金托管人的托管费; 3.基金销售服务费; 4.《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用; 5.《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费;

6.基金份额持有人大会费用; 7.基金的证券交易费用; 8.基金的银行汇划费用; 9.证券账户开户费用、账户维护费用; 10.按照中国证监会有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

第十三部分 基金的投资目标 本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。

第十四部分 对招募说明书更新内容的说明 本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(证监会公告[2016]9号)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的规定,结合本基金管理人对于本基金基金的投资管理活动,对本基金管理人原公告的本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下: 重要提示:本次更新了本次招募说明书更新的内容。

鹏华基金管理有限公司 2020年4月

基金管理人:鹏华基金管理有限公司 基金托管人:中国光大银行股份有限公司

鹏华添利宝货币市场基金更新的招募说明书摘要

(基金合同第1号)

基金管理人:鹏华基金管理有限公司 基金托管人:中国光大银行股份有限公司

基金管理人:鹏华基金管理有限公司 基金托管人:中国光大银行股份有限公司