

# 鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金 清算报告

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

清算报告出具日：2021年12月17日

清算报告公告日：2021年12月24日

# 目录

§1 重要提示 .....	3
§2 基金概况 .....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
§3 基金运作情况 .....	5
§4 财务会计报告 .....	6
4.1 资产负债表（已经审计）.....	6
4.2 清算损益表.....	7
§5 清算情况 .....	8
5.1 清算费用.....	8
5.2 最后运作日资产处置情况.....	8
5.3 最后运作日负债清偿情况.....	9
5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况.....	9
5.5 基金清算报告的告知及剩余财产分配安排.....	10
§6 备查文件 .....	11
6.1 备查文件目录.....	11
6.2 存放地点.....	11
6.3 查阅方式.....	11

## § 1 重要提示

鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2019 年 11 月 4 日证监许可[2019]2192 号文批准注册。《鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）于 2020 年 8 月 26 日正式生效。基金管理人为鹏扬基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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运作管理办法》、《鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》以及本基金管理人于 2021 年 9 月 9 日发布的《鹏扬基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。上述议案于 2021 年 10 月 12 日获得通过，本次基金份额持有人大会决议自同日起生效。本基金管理人于 2021 年 10 月 13 日发布《关于鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金以 2021 年 10 月 13 日为最后运作日，自 2021 年 10 月 14 日起，本基金进入基金财产清算程序。

本基金自 2021 年 10 月 14 日起进入财产清算期，基金管理人、基金托管人、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于 2021 年 10 月 14 日成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海源泰律师事务所对清算事宜出具法律意见。

## § 2 基金概况

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	鹏扬淳选一年定开债券
基金主代码	008360
交易代码	008360
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年8月26日
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,000,000.00份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争为基金份额持有人创造稳定的当期收益和长期回报。
投资策略	本基金的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属和板块轮换策略、骑乘策略、信用债投资策略、适度的融资杠杆策略、资产支持证券投资策略等。本基金投资中将根据对宏观经济周期和市场环境的持续跟踪以及对经济政策的深入分析，灵活运用上述策略，构建债券组合并进行动态调整，以达成投资目标。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

### § 3 基金运作情况

本基金经中国证监会于 2019 年 11 月 4 日证监许可[2019]2192 号文批准注册，由基金管理人依照法律法规、本基金基金合同、招募说明书等规定自 2020 年 8 月 17 日至 2020 年 8 月 24 日期间向社会公开募集。本基金基金合同于 2020 年 8 月 26 日正式生效，募集规模为 999,999,000.00 份（含募集期间利息结转的份额）基金份额，有效认购户数为 2 户。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

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运作管理办法》、《鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》以及本基金管理人于 2021 年 9 月 9 日发布的《鹏扬基金管理有限公司关于以通讯方式召开鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于终止鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》。上述议案于 2021 年 10 月 12 日获得通过，本次基金份额持有人大会决议自同日起生效。本基金管理人于 2021 年 10 月 13 日发布《关于鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本基金以 2021 年 10 月 13 日为最后运作日，自 2021 年 10 月 14 日起，本基金进入基金财产清算程序。

## § 4 财务会计报告

### 4.1 资产负债表（已经审计）

会计主体：鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年10月13日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	2021年10月13日 (基金最后运作日)
<b>资产：</b>	
银行存款	38,421.47
结算备付金	293,745.97
存出保证金	2,337.81
交易性金融资产	8,501,700.00
买入返售金融资产	4,300,000.00
应收证券清算款	235.62
应收利息	61,276.75
资产总计	13,197,717.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>2021年10月13日 (基金最后运作日)</b>
<b>负债：</b>	
卖出回购金融资产款	2,700,000.00
应付管理人报酬	1,186.92
应付托管费	395.68
应付交易费用	10,251.42
应付利息	358.02
其他负债	156,632.88
负债合计	2,868,824.92
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	10,000,000.00
未分配利润	328,892.70
所有者权益合计	10,328,892.70
负债和所有者权益总计	13,197,717.62

注：(1)报告截止日2021年10月13日（基金最后运作日），基金份额总额10,000,000.00份，基金份额净值1.0329元。

(2) 本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。基金管理人编制清算报表是为了呈报鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金全体持有人以及中国证监会使用。因此，清算报表可能不适用于其他用途。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已对财务报表进行了审计并出具了无保留意见的审计报告。

#### 4.2 清算损益表

项目	2021年10月14日至2021年12月8日 (清算期间)
<b>一、清算收益</b>	
1. 利息收入	13,164.86
2. 处置交易性金融资产产生的净收益	828.00
清算收益小计	13,992.86
<b>二、清算费用</b>	
1. 交易费用	-141.44
2. 利息支出	716.06
3. 银行汇划费	30.00
清算费用小计	604.62
<b>三、清算收益总额</b>	13,388.24
减：所得税费用	-
<b>四、清算净收益</b>	13,388.24

注：(1) 利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2021年10月14日至2021年12月8日止清算期间的活期存款、清算备付金、存出保证金利息，以及债券利息收入、买入返售金融资产利息收入。

(2) 处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出债券成交金额扣除最后运作日债券市值和截至变现日应收债券利息后的净额。

(3) 交易费用包括清算期间处置债券投资产生的交易费用人民币8.56元及因统一调整上期中央国债登记结算有限责任公司债券结算服务费而调减的交易费用人民币150.00元。

(4) 利息支出系清算期间卖出回购金融资产款利息。

(5) 除上述清算费用外的其他与本次清算相关的清算费用由本基金管理人承担，不从基金财产中支付。

## § 5 清算情况

自 2021 年 10 月 14 日起至 2021 年 12 月 8 日止为本基金清算报告期，基金财产清算组按照法律法规及《基金合同》等规定履行基金财产清算程序，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

### 5.1 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

### 5.2 最后运作日资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 293,745.97 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 2 个工作日对结算备付金进行调整，该款项已于 2021 年 12 月 2 日全部收回并划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 2,337.81 元，为存放于中国证券登记结算有限责任公司的结算保证金，清算期间增加存出保证金人民币 952.07 元，共计人民币 3,289.88 元。中国证券登记结算有限责任公司每月初第 2 个工作日对存出保证金进行调整，上述款项中人民币 1,873.25 元已于 2021 年 12 月 2 日划入托管账户。为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，本基金管理人以自有资金对尚未收回的结算保证金人民币 1,416.63 元进行垫付，该垫付资金将于款项收回后返还给基金管理人。

(3) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 8,501,700.00 元，全部为债券投资，已于清算期间全部卖出。

(4) 本基金最后运作日买入返售金融资产为人民币 4,300,000.00 元，已于 2021 年 10 月 14 日全部变现。

(5) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币 235.62 元，已于 2021 年 10 月 14 日划入托管账户。

(6) 本基金最后运作日应收利息为人民币 61,276.75 元，其中应收债券利息为人民币 56,915.17 元，参见最后运作日资产处置情况 (3) 所述，已于清算期间处置变现并划入托管账户。应收活期存款利息为人民币 215.59 元，应收最低备付金利息为人民币 4,144.06 元，应收结算保证金利息为人民币 1.93 元。截至清算报告期结束日（2021 年 12 月 8 日），



上述款项尚未收回。为了提高清算效率，及时向基金份额持有人分配剩余财产，本基金管理人以自有资金对尚未收回的应收利息进行垫付，该垫付资金将于结息后返还给基金管理人。

### 5.3 最后运作日负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日卖出回购金融资产款为人民币 2,700,000.00 元，该款项已于 2021 年 10 月 15 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,186.92 元，该款项已于 2021 年 11 月 2 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 395.68 元，该款项已于 2021 年 11 月 2 日支付。

(4) 本基金最后运作日应付交易费用为人民币 10,251.42 元，该款项已于 2021 年 10 月 21 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付利息为人民币 358.02 元，该款项已于 2021 年 10 月 15 日支付。

(6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 156,632.88 元。其中，预提审计费为人民币 15,000.00 元，预提信息披露费为人民币 79,232.88 元，预提律师费为人民币 20,000.00 元，应付持有人大会公证费为人民币 10,000.00 元，应付持有人大会律师费为人民币 20,000.00 元，预提账户维护费为人民币 12,400.00 元。其中，应付持有人大会公证费、应付持有人大会律师费、预提账户维护费已分别于 2021 年 11 月 1 日、2021 年 11 月 2 日、2021 年 10 月 22 日付清，预提审计费、预提信息披露费、预提律师费截至清算报告日尚未支付。

### 5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

项目	金额
一、最后运作日 2021 年 10 月 13 日基金净资产	10,328,892.70
加：清算期间（2021 年 10 月 14 日至 2021 年 12 月 8 日）净收益	13,388.24
二、2021 年 12 月 8 日基金净资产	10,342,280.94

截至本次清算期结束日 2021 年 12 月 8 日，本基金剩余财产为人民币 10,342,280.94 元。自本次清算期结束日次日至清算款划出日前一日的存款利息归基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付中登冻结的存出保证金及未结息的利息（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后收到相关款项时返还给基金管理人，差额由基金管理人承担。

## 5.5 基金清算报告的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，将与会计师事务所出具的清算审计报告、律师事务所出具的法律意见书一并报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行剩余财产分配。

## § 6 备查文件

### 6.1 备查文件目录

- (1) 《鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 关于《鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金清算报告》的法律意见。

### 6.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人、基金托管人处。

### 6.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。

鹏扬淳选一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金财产清算小组

2021年12月24日