

# 鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金

## 清算报告

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

清算报告出具日：2026年4月10日

清算报告公告日：2026年4月18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（已经审计） .....        | 6  |
| 4.1 资产负债表 .....              | 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

鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]303号《关于准予鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金注册的批复》注册,由鹏扬基金管理有限公司于2024年8月2日至2024年10月25日向社会公开募集。《鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金基金合同》于2024年10月29日正式生效,基金管理人为鹏扬基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”或“基金管理人”),基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“基金托管人”)。

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运作管理办法》、《鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定以及本基金管理人于2026年4月3日发布的《关于鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金以2026年4月2日为最后运作日,自2026年4月3日起,本基金进入基金财产清算程序。

本基金自2026年4月3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)和上海市通力律师事务所成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序,本次清算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,上海市通力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               | 鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金 |               |
| 基金简称               | 鹏扬聚优睿选混合        |               |
| 基金主代码              | 020918          |               |
| 基金运作方式             | 契约型开放式          |               |
| 基金合同生效日            | 2024年10月29日     |               |
| 基金管理人              | 鹏扬基金管理有限公司      |               |
| 基金托管人              | 中国建设银行股份有限公司    |               |
| 最后运作日基金份额总额        | 13,167,477.18份  |               |
| 下属分级基金的基金简称        | 鹏扬聚优睿选混合A       | 鹏扬聚优睿选混合C     |
| 下属分级基金的交易代码        | 020918          | 020919        |
| 最后运作日下属分级基金的基金份额总额 | 10,614,400.10份  | 2,553,077.08份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在控制风险的前提下，精选优质上市公司进行投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。                              |
| 投资策略   | 本基金的投资策略包括：类属资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资业务策略。            |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*65%+恒生指数收益率*15%+中债综合指数收益率*20%                                |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金可能投资于港股通标的股票，需承担汇率风险及境外市场的风险。 |

### § 3 基金运作情况

本基金系经中国证监会证监许可[2024]303号《关于准予鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金注册的批复》注册，由鹏扬基金管理有限公司于2024年8月2日至2024年10月25日向社会公开募集，首次募集的有效净认购金额为人民币486,660,702.39元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币185,535.90元。经向中国证监会备案，基金合同于2024年10月29日生效，基金合同生效日的基金份额总额为486,846,238.29份基金份额，其中认购资金利息折合185,535.90份基金份额，本基金为契约型开放式，存续期限不定。

自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《基金合同》“第五部分基金备案”之“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。”截至2026年4月2日日终，本基金已出现连续50个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。根据基金合同约定，且经与基金托管人协商一致，基金管理人决定终止本基金基金合同并依法履行基金财产清算程序，此事项不需要召开基金份额持有人大会。本基金以2026年4月2日为最后运作日，自2026年4月3日起，本基金进入基金财产清算程序。

## § 4 财务会计报告（已经审计）

### 4.1 资产负债表

会计主体：鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 4 月 2 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

| 资产            | 2026 年 4 月 2 日<br>(基金最后运作日)         |
|---------------|-------------------------------------|
| <b>资产：</b>    |                                     |
| 货币资金          | 10,544,629.57                       |
| 结算备付金         | 1,329,670.71                        |
| 存出保证金         | 14,423.66                           |
| 交易性金融资产       | 100,250.71                          |
| 其中：债券投资       | 100,250.71                          |
| 应收清算款         | 6,830,345.93                        |
| 应收股利          | 9,338.17                            |
| 资产总计          | 18,828,658.75                       |
| <b>负债和净资产</b> | <b>2026 年 4 月 2 日<br/>(基金最后运作日)</b> |
| <b>负债：</b>    |                                     |
| 应付赎回款         | 5,801,923.17                        |
| 应付管理人报酬       | 1,651.87                            |
| 应付托管费         | 275.31                              |
| 应付销售服务费       | 256.58                              |
| 应交税费          | 65.43                               |
| 其他负债          | 78,090.25                           |
| 负债合计          | 5,882,262.61                        |
| <b>净资产：</b>   |                                     |
| 实收基金          | 13,167,477.18                       |
| 未分配利润         | -221,081.04                         |
| 净资产合计         | 12,946,396.14                       |
| 负债和净资产总计      | 18,828,658.75                       |

注：(1) 报告截止日 2026 年 4 月 2 日（基金最后运作日），基金份额总额 13,167,477.18 份，其中鹏扬聚优睿选混合 A 基金份额净值 0.9848 元，基金份额总额 10,614,400.10 份；其中鹏扬聚优睿选混合 C 基金份额净值 0.9767 元，基金份额总额 2,553,077.08 份。

(2) 本基金的清算报表是参考《企业会计准则》及《资产管理产品相关会计处理规定》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聚优睿选混合型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。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清算审计报告。

#### 4.2 清算损益表

| 项 目                | 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 10 日<br>(清算期间) |
|--------------------|---|
| <b>一、清算期间收益</b>    |   |
| 利息收入（注 1）          | 855.23                                    |
| 交易性金融资产产生的净收益（注 2） | 17.24                                     |
| 股利收益（注 3）          | -2,778.39                                 |
| 其他收入（注 4）          | 63.13                                     |
| 清算收益小计             | -1,842.79                                 |
| <b>二、清算期间费用</b>    |   |
| 税金及附加              | 0.01                                      |
| 其他费用（注 5）          | 4.36                                      |
| 清算费用小计             | 4.37                                      |
| <b>三、清算收益总额</b>    | -1,847.16                                 |
| 减：所得税费用            |   |
| <b>四、清算期间净收益</b>   | -1,847.16                                 |

注：(1) 利息收入系以当前适用的利率预估计提的自 2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 10 日止清算期间的货币资金、清算备付金、存出保证金利息。

(2) 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、截至变现日债券应计利息和卖出债券产生的交易费用后的净额，以及交易性债券利息收入适用情况下的相关税费后的金额。

(3) 股利收益系因红利补税冲减的股利收入。

(4) 其他收入系基金赎回费和基金转出费归入基金资产的收入。

(5) 其他费用系清算期间产生的港股通证券组合费。

## § 5 清算情况

自 2026 年 4 月 3 日起至 2026 年 4 月 10 日止为本基金清算报告期，基金财产清算小组按照法律法规及《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程序进行。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剩余财产中支付。

### 5.2 最后运作日资产处置情况

- (1) 本基金最后运作日货币资金为人民币 10,544,629.57 元，其中活期存款本金为人民币 10,543,975.04 元，活期存款应计利息为人民币 654.53 元；截至清算期结束日，活期存款本金为人民币 12,311,101.86 元，活期存款应计利息余额为人民币 1,412.38 元。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 1,329,670.71 元，其中上海结算备付金本金为人民币 50,457.26 元，上海结算备付金应计利息为人民币 6.37 元，深圳结算备付金本金为人民币 1,975.91 元，深圳结算备付金应计利息为人民币 0.26 元，沪港通备付金本金为人民币 1,277,134.35 元，沪港通备付金应计利息为人民币 96.08 元，期货备付金应计利息为人民币 0.48 元。截至清算期结束日，沪港通备付金本金和期货备付金应计利息已划回托管账户，上海结算备付金本金为人民币 10,144.26 元，上海结算备付金应计利息为人民币 9.51 元，深圳结算备付金本金为人民币 4,063.56 元，深圳结算备付金应计利息为人民币 0.46 元，港股通备付金应计利息为人民币 188.85 元。
- (3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 14,423.66 元，其中上海存出保证金本金为人民币 6,676.55 元，上海存出保证金应计利息为人民币 0.78 元，深圳存出保证金本金为人民币 7,745.11 元，深圳存出保证金应计利息为人民币 0.92 元，上海港股通风控资金应计利息为人民币 0.30 元。截至清算期结束日，存出保证金本金无变化，上海存出保证金应计利息为人民币 1.26 元，深圳存出保证金应计利息为人民币 1.56 元，上海港股通风控资金应计利息为人民币 0.37 元。

- (4) 本基金最后运作日交易性金融资产为人民币 100,250.71 元，均为债券投资，该部分已于清算期间处置变现，变现产生的资金为人民币 100,268.05 元，已于清算期间划回本基金托管账户。
- (5) 本基金最后运作日应收清算款为人民币 6,830,345.93 元，该款项已于清算期间划回本基金托管账户。
- (6) 本基金最后运作日应收股利为人民币 9,338.17 元，系持有沪港通标的股票产生的应收股利，截至本次清算期末，该部分股利尚未收到，因结算汇率变动原因，实际收取金额与预提金额可能存在差异，将在实际收到款项后根据实际收取金额按基金份额持有人持有的基金份额比例及时分配。

### 5.3 最后运作日负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币 5,801,923.17 元，该款项已于清算期间支付。
- (2) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,651.87 元，该款项已于清算期间支付。
- (3) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 275.31 元，该款项已于清算期间支付。
- (4) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 256.58 元，该款项已于清算期间支付。
- (5) 本基金最后运作日应交税费为人民币 65.43 元，该款项已于清算期间支付。
- (6) 本基金最后运作日其他负债为人民币 78,090.25 元，其中应付赎回费为人民币 0.23 元，应付交易费用为人民币 37,392.02 元，预提审计费为人民币 17,000.00 元，预提信息披露费为人民币 11,698.00 元，预提律师费为人民币 12,000.00 元。应付赎回费、应付交易费用、律师费已于清算期间支付，审计费、信息披露费将于清算期结束之后支付。

### 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 2026 年 4 月 2 日基金净资产                | 12,946,396.14 |
| 加：清算期间（2026 年 4 月 3 日至 2026 年 4 月 10 日）净收益 | -1,847.16     |
| 减：基金净赎回转出金额（于 2026 年 4 月 3 日确认的投资者赎回、转出申请） | 622,563.08    |
| 二、2026 年 4 月 10 日基金净资产                     | 12,321,985.90 |

根据本基金的基金合同，本基金将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费

用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

截至本次清算期结束日2026年4月10日，本基金剩余财产为人民币12,321,985.90元，其中包括应收股利9,338.17元（该金额因汇率变动原因与最终实际收取金额可能存在差异），上述资产将在实际收到款项后根据实际收取金额按基金份额持有人持有的基金份额比例进行再次分配。清算起始日2026年4月3日至最终清算款划出前一日的活期存款、清算备付金、存出保证金利息亦属基金份额持有人所有，以上利息均按实际适用的利率计算。

## 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) 《鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 上海市通力律师事务所关于《鹏扬聚优睿选混合型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。

鹏扬聚优睿选混合型证券投资基金基金财产清算小组

2026年4月10日