

鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金

清算报告

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

清算报告出具日：2026年4月15日

清算报告公告日：2026年4月30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.....	8
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.....	9
§ 6 备查文件	10
6.1 备查文件目录	10
6.2 存放地点	10
6.3 查阅方式	10

§ 1 重要提示

鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金(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[2022]3250号《关于准予鹏扬裕利三年封闭式债券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2023年3月27日至2023年4月12日向社会公开募集。《鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金基金合同》于2023年4月13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”),基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(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》、《鹏扬裕利三年封闭式债券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14日发布的《关于鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金基金份额自动赎回、进入清算期及终止基金合同的公告》,本基金成立于2023年4月13日,《基金合同》生效后封闭运作三年,2026年4月13日为封闭期到期日,本基金将在封闭期到期日对基金份额进行自动赎回,《基金合同》将于封闭期到期日的次一工作日自动终止并进入基金财产清算程序,不需要召开基金份额持有人大会审议。

本基金最后运作日为2026年4月13日,自2026年4月14日起,本基金进入基金财产清算程序。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2026年4月14日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	鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金
基金简称	鹏扬裕利三年封闭债券
基金主代码	017817
交易代码	017817
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2023年4月13日
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
最后运作日基金份额总额	2,794,647,207.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极主动的资产配置，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持有到期型单元投资策略和交易型单元投资策略，其中交易型单元投资策略包括债券品种轮换策略、时机选择策略、利率预期策略、信用债投资策略、可转债/可交换债投资策略、衍生品投资策略等。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，构建投资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	本基金属于债券型基金，风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。

§ 3 基金运作情况

本基金系经中国证监会证监许可[2022]3250号《关于准予鹏扬裕利三年封闭式债券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2023年3月27日至2023年4月12日向社会公开募集，首次募集的有效净认购金额为人民币2,794,525,439.26元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币121,767.90元。经向中国证监会备案，基金合同于2023年4月13日生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,794,647,207.16份基金份额，其中认购资金利息折合121,767.90份基金份额，本基金为契约型封闭式，存续期为三年。

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《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》、《基金合同》的有关规定以及本基金管理人于2026年4月14日发布的《关于鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金基金份额自动赎回、进入清算期及终止基金合同的公告》，本基金成立于2023年4月13日，《基金合同》生效后封闭运作三年，2026年4月13日为封闭期到期日，本基金将在封闭期到期日对基金份额进行自动赎回，《基金合同》将于封闭期到期日的次一工作日自动终止并进入基金财产清算程序，不需要召开基金份额持有人大会审议。本基金最后运作日为2026年4月13日，自2026年4月14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：鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金

报告截止日：2026年4月13日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资 产	2026年4月13日 (基金最后运作日)
资产：	
货币资金	2,851,561,236.60
结算备付金	983.84
存出保证金	16,684.11
资产总计	2,851,578,904.55
负债和净资产	2026年4月13日 (基金最后运作日)
负债：	
应付管理人报酬	333,124.59
应付托管费	55,520.78
应交税费	98,223.58
其他负债	190,814.42
负债合计	677,683.37
净资产：	
实收基金	2,794,647,207.16
未分配利润	56,254,014.02
净资产合计	2,850,901,221.18
负债和净资产总计	2,851,578,904.55

注：(1) 报告截止日 2026 年 4 月 13 日（基金最后运作日），基金份额总额 2,794,647,207.16 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裕利三年封闭式债券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14日至2026年4月15日 (清算期间)
一、清算期间收益	57,042.71
利息收入(注1)	57,042.71
二、清算期间费用	-
三、清算收益总额	57,042.71
减: 所得税费用	-
四、清算期间净收益	57,042.71

注1: 利息收入系以当前适用的利率预估计提的清算期间的货币资金、存出保证金利息。

§ 5 清算情况

自 2026 年 4 月 14 日起至 2026 年 4 月 15 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 2,851,561,236.60 元，其中活期存款本金为人民币 2,851,501,957.88 元，活期存款应计利息为人民币 59,278.72 元。上述款项将于 2026 年 4 月 15 日后划回托管账户。为保护基金份额持有人利益，加快清算效率，基金管理人已使用自有资金先行垫付尚未结息的应计活期存款利息。
- (2) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 983.84 元，其中上海结算备付金应计利息为人民币 303.62 元；深圳结算备付金应计利息为人民币 672.60 元；期货备付金本金为人民币 4.26 元，期货备付金应计利息为人民币 3.36 元。上述款项将于 2026 年 4 月 15 日后划回托管账户。为保护基金份额持有人利益，加快清算效率，基金管理人已使用自有资金先行垫付尚未返还的结算备付金。
- (3) 本基金最后运作日存出保证金为人民币 16,684.11 元，其中上海存出保证金本金为人民币 5,332.93 元，上海存出保证金应计利息为人民币 1.20 元；深圳存出保证金本金为人民币 11,347.70 元，深圳存出保证金应计利息为人民币 2.28 元。上述款项将于 2026 年 4 月 15 日后划回托管账户。为保护基金份额持有人利益，加快清算效率，基金管理人已使用自有资金先行垫付尚未返还的存出保证金。

5.3 最后运作日负债清偿情况

- (1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 333,124.59 元，该款项将于清算期结束之后支付。

- (2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 55,520.78 元, 该款项将于清算期结束之后支付。
- (3) 本基金最后运作日应交税费为人民币 98,223.58 元, 该款项将于清算期结束之后支付。
- (4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 190,814.42 元, 其中应付账户维护费为人民币 12,400.00 元, 应付 2025 年度审计费为人民币 60,000.00 元, 预提清算审计费为人民币 14,000.00 元, 应付信息披露费为人民币 30,000.00 元, 应付律师费为人民币 20,000.00 元, 应付交易费用为人民币 54,414.42 元。1 季度应付账户维护费、应付交易费用已于清算期间支付, 剩余应付账户维护费、应付交易费用、审计费、律师费、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 13 日基金净资产	2,850,901,221.18
加: 清算期间 (2026 年 4 月 14 日至 2026 年 4 月 15 日) 净收益	57,042.71
减: 基金净赎回金额 (于清算期间确认的最后运作日份额赎回)	2,850,958,251.38
二、清算结束日 2026 年 4 月 15 日基金净资产	12.51

截至赎回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, 基金管理人以自有资金先行垫付截至赎回款划出日前的相关应收未收款项。基金管理人垫付的资金以及垫付资金期间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, 差异由基金管理人承担。

截至本次清算期结束日 2026 年 4 月 15 日, 本基金剩余财产为人民币 12.51 元, 为基金管理人垫付资金期间孳生的利息, 将于清算期后返还给基金管理人。

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。本基金清算财产已全部于 2026 年 4 月 15 日全额支付投资者赎回款项, 后续不涉及对投资者的财产分配。

§ 6 备查文件

6.1 备查文件目录

- (1) 《鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金清算审计报告》；
- (2) 上海源泰律师事务所关于《鹏扬裕利三年封闭式债券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。

鹏扬裕利三年封闭式债券型证券投资基金基金财产清算小组

2026年4月15日