鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金清算报告

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

公告日期：　2026 年 11 月 3 日

一、重要提示

鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金(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”）证监许可〔2022〕2490 号文准予注册，于 2023 年 03 月 14 日成立并正式运作。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，本基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“《基金合同》”)有关规定，基金合同生效后，连续 50 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 万元的，基金管理人应当终止《基金合同》，不需召开基金份额持有人大会。截至 2026 年 9 月 8 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，已触发基金合同中约定的本基金终止条款，基金管理人应当终止《基金合同》。

2026 年 09 月 15 日为本基金最后运作日，本基金从 2026 年 09 月 16 日起进入清算期，由本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、德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

1、基金基本情况

基金名称	鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	鹏华安锦一年持有期混合	
基金主代码	017083	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 03 月 14 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	
最后运作日(2026 年 09 月 15 日)基金份额总额	26,972,228.56 份	
下属分级基金的基金简称	鹏华安锦一年持有期混合 A	鹏华安锦一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	017083	017084
最后运作日(2026 年 09 月 15 日)下属分级基金的份额总额	20,823,880.93 份	6,148,347.63 份

最后运作日(2026 年 09 月 15 日)下属分级基金的份额净值	1.0297 元	1.0117 元

2、基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，合理配置债券等固定收益类资产和权益类资产，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。 2、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、信用资产（含资产支持证券）投资策略、可转债投资策略及可交换债券投资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，本基金将据此调整组合长、中、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 本基金将采用息差策略，以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。 （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、税赋特点等因素，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）信用资产（含资产支持证券，下同）投资策略 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，结合对类似资产信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用资产进行投资。其中，本基金投资信用资产的评

	级范围为 AA 至 AAA，投资于各个信用等级信用资产占信用资产的比例如下： 信用等级 占比 AAA 50%-100% AA+ 0%-50% AA 0%-20% 上述信用评级为债项评级，短期融资券、超短期融资券等短期信用资产的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级，本基金投资的信用资产若无债项评级的，参照主体信用评级。本基金将综合参考国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构所出具的信用评级，评级机构不包含中债资信。本基金持有信用资产期间，如果其评级下降、不再符合上述约定，应在评级报告发布之日起 3 个月内调整至符合约定。 （7）可转债投资策略及可交换债券投资策略 1）传统可转债投资策略 传统可转债即可转换公司债券，兼具债权和股权双重属性。债权属性是指投资者可以选择持有可转债到期，得到本金与利息收益；股权属性即股票期权属性，是指投资者可以在转股期间以约定的转股价格把可转债转换成股票。因此，可转债的价格由债权价格和期权价格两部分组成。 a.个券选择策略。一方面，本基金将对所有可转债对应的标的股票进行深入研究，采用定性分析（行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等）与定量分析（P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV 等）相结合的方式挑选成长性好且估值合理的正股；另一方面，本基金将深入研究分析可转债自身的信用评估。综上所述，本基金将结合可转债自身的信用评估和其正股的价值分析，作为选取个券的重要依据。 b.条款价值发现策略。可转债一般均设有一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等，这些条款在特定环境下对可转债价值有着较大的影响。本基金将通过有效分析相关信息力争把握各项条款给可转债带来的可能的投资机会。 c.套利策略。可转债可以按照约定的价格转换为股票，因此在日常交易运作过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当处于转股期内的可转债市价低于转股价值，即可转债的转换溢价率为负时，买入可转债的同时卖出标的股票可以获得套利价差；反之，买入标的股票的同时卖出可转债也可以获取反向套利价差。在日常交易运作中，本基金将密切关注可转债与标的股票之间价格之间的对比关系，择机实施套利策略，以增强本基金的收益。 2）分离交易可转债投资策略 本基金在对这类债券基本情况进行研究的同时，将重点分析附权部分对债券估值的影响。对于分离交易可转债的债券部分将按照债券投资策略进行管理，权证部分将在可交易之日起不超过 3 个月的时

	间内卖出。 3）可交换债券投资策略 可交换债券具有股性和债性，其中债性，即选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的纯债部分价值分析综合开展投资决策。 3、股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的公司，构建股票投资组合。本基金将重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素等因素进行自上而下的行业遴选，同时结合对上市公司的竞争力分析、管理层分析等定性分析和对上市公司的关键估值方法（包括 PE、PEG、PB、PS、EV/EBITDA 等）等定量分析进行自下而上的个股精选。 本基金所投资港股通标的股票除适用上述个股投资策略外，还需关注： 1）在港股市场上市、具有行业代表性的优质中资公司； 2）具有行业稀缺性的香港本地和外资公司； 3）港股市场在行业结构、估值、AH 股折溢价、分红率等方面具有吸引力的投资标的。 4、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。 5、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。 6、股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果。 7、参与融资业务策略 本基金可在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素基础上，参与融资业务。 未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新并公告。

业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%（经汇率估值调整）	
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
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

三、基金运作情况

1、基金基本情况

本基金经中国证监会证监许可[2022]2490 号《关于准予鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》准予，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 594,762,096.47 元，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(23)第 00076 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2023 年 3 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 594,956,886.31 份基金份额，其中认购资金利息折合 194,789.84 份基金份额。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。

自 2023 年 03 月 14 日至 2026 年 09 月 15 日期间，本基金按基金合同约定正常运作。

2、清算原因

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”中的约定：“《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审议。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”截至 2026 年 9 月 8 日日终，本基金基金资产净值已连续 50 个工作日低于 5000 万元。根据《基金合同》的上述约定，基金管理人应当终止《基金合同》。本基金管理人将根据《基金合同》的约定进入基金财产的清算程序并终止《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会审议。

3、清算起始日

本基金从 2026 年 09 月 16 日起进入清算期，清算期间为 2026 年 09 月 16 日至 2026 年 09 月 21 日。

4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考财政部颁布的《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”)、《资产管理产品相

关会计处理规定》(财会[2022]14 号)及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》的有关规定编制的。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。

四、财务会计报告

资产负债表

会计主体：鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日： 2026 年 09 月 15 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2026 年 09 月 15 日
资 产：	
货币资金	21,972,649.86
结算备付金	223,933.55
存出保证金	1,951.76
交易性金融资产	9,186,248.36
其中：股票投资	9,186,248.36
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其中：债券投资	-
资产支持证券投资	-
其他投资	-
其他债权投资	-
其他权益工具投资	-
应收清算款	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	31,384,783.53
负债和净资产	**最后运作日 2026 年 09 月 15 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	-

应付清算款	0.69
应付赎回款	3,686,094.48
应付管理人报酬	14,636.22
应付托管费	2,195.44
应付销售服务费	1,406.22
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	17,795.89
负债合计	3,722,128.94
净资产：	
实收基金	26,972,228.56
其他综合收益	-
未分配利润	690,426.03
净资产合计	27,662,654.59
负债和净资产总计	31,384,783.53

五、清算情况

在清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，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：

1、清算费用

按照《基金合同》的规定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，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。

2、资产处置情况

（1）结算备付金、存出保证金、应收款和其他资产处置情况

单位：人民币元

序号	项目	最后运作日账面价值	清算期变动金额(账面价值减少以“-”号填列)	清算期期末账面价值
1	结算备付金	223,933.55	-124.03	223,809.52
2	存出保证金	1,951.76	-4.38	1,947.38
3	应收清算款	-	1,665.59	1,665.59
4	应收股利	-	-	-
5	应收申购款	-	-	-
6	递延所得税资产	-	-	-
7	其他资产	-	-	-

（2）金融资产处置情况

单位：人民币元

序号	项目	最后运作日账面价值	清算期内最后处置日	清算金额	清算期期末账面价值
1	股票投资	9,186,248.36	2026 年 09 月 18 日	9,121,814.13	-
2	基金投资	-	-	-	-
3	债券投资	-	-	-	-
4	资产支持证券投资	-	-	-	-
5	贵金属投资	-	-	-	-
6	其他投资	-	-	-	-
7	衍生金融资产	-	-	-	-
8	买入返售金融资产	-	-	-	-

3、负债清偿情况

单位：人民币元

序号	项目	最后运作日金额	清算期变动金额（账面价值减少以“-”号填列）	清算期期末金额
1	短期借款	-	-	-
2	交易性金融负债	-	-	-
3	衍生金融负债	-	-	-
4	卖出回购金融资产款	-	-	-
5	应付清算款	0.69	-0.69	-
6	应付赎回款	3,686,094.48	-3,686,094.48	-
7	应付管理人报酬	14,636.22	-	14,636.22
8	应付托管费	2,195.44	-	2,195.44
9	应付销售服务费	1,406.22	-	1,406.22
10	应付投资顾问费	-	-	-
11	应交税费	-	-	-
12	应付利润	-	-	-
13	递延所得税负债	-	-	-
14	其他负债	17,795.89	15,115.67	32,911.56

注：无。

4、清算期的清算损益情况

单位：人民币元

项目	2026 年 09 月 16 日 至 2026 年 09 月 21 日
一、收入	-69,859.86
1.利息收入	1,433.02
其中：存款利息收入	1,433.02
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以"－"号填列）	-2,723,758.08
其中：股票投资收益	-2,721,215.10
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	-2,542.98
其他投资收益	-
3.公允价值变动收益（损失以"－"号填列）	2,652,465.20
4.汇兑收益（损失以"－"号填列）	-
5.其他收入（损失以"－"号填列）	-
二、费用	15,302.05
1.管理人报酬	-
2.托管费	-
3.销售服务费	-
4.投资顾问费	-
5.利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6.信用减值损失	-
7.税金及附加	-
8.其他费用	15,302.05
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-85,161.91
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-85,161.91
五、其它综合收益的税后净额	-85,161.91
六、综合收益总额	-85,161.91

注：无。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2026 年 09 月 15 日基金净资产	27,662,654.59
鹏华安锦一年持有期混合 A	21,442,453.08
鹏华安锦一年持有期混合 C	6,220,201.51
加：清算期间净收益	-85,161.91
加：应付利润结转实收基金金额	-
减：净赎回金额（含费用）	409,363.06
二、2026 年 09 月 21 日基金净资产	27,168,129.62
鹏华安锦一年持有期混合 A	21,068,242.59
鹏华安锦一年持有期混合 C	6,099,887.03

根据本基金的基金合同约定，依据基金财产清算的分配方案，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。

清算期结束日次日至清算款划出日前一日的银行存款、结算备付金和存出保证金等产生的利息归基金份额持有人所有。于清算划款日基金管理人以自有资金先行垫付基金资产中尚未返还的应收利息、结算备付金和存出保证金余额。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。垫付资金及其孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

6、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

（1）鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金资产负债表及审计报告；

（2）关于《鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金清算报告》的法律意见。

2、存放地点

基金管理人的办公场所。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

鹏华安锦一年持有期混合型证券投资基金基金财产清算小组

2026 年 11 月 3 日