

# 鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金 中基金（FOF）清算报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

公告日期：2023 年 11 月 22 日

## 一、重要提示

鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（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”）《关于准予鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》（证监许可〔2020〕284 号）批准，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》及其配套规则和《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”或“基金合同”）发售，基金合同于 2020 年 7 月 21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 381,756,163.42 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，基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据基金合同有关规定，《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，基金管理人应当终止《基金合同》，无须召开基金份额持有人大会。截至 2023 年 10 月 9 日，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，基金合同自动终止。

本基金从 2023 年 10 月 17 日起进入清算期，由本基金管理人鹏华基金管理有限公司、基金托管人华夏银行股份有限公司、普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰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，并由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰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	鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	鹏华聚合多资产混合（FOF）
基金主代码	009787
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 21 日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
最后运作日（2023 年 10 月 16 日）基金份额总额	610,096.30 份

最后运作日（2023 年 10 月 16 日）基金份额净值	0.9810 元
-------------------------------	----------

## 2、基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过科学的大类资产配置，优选基金力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金通过合理判断市场走势，合理配置基金、股票、债券等投资工具的比例，通过定量和定性相结合的方法精选具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的稳健增值。</p> <p>1、资产配置策略在资产配置上，本基金将结合产品定位、风险收益特征以及管理人的长期资本市场观点确定基金的资产配置方案。首先，管理人将根据基金业绩基准确定产品的风险收益特征。其次，本基金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。最后，结合本基金以及各资产类别的风险收益特征，并依据现代投资组合理论，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。本基金将密切关注市场风险的变化以及各资产类别的风险收益的相对变化趋势，在业绩比较基准所确定的产品风险收益特征基础上，以收益风险比最大化为原则，通过定性方式适度调整本基金的资产配置比例。原则上，管理人参考公司投资决策委员会对大类资产进行评估，检视大类资产的市场展望和中长期资本市场观点是否发生改变，根据评估情况决定是否进行资产配置的动态再平衡。当资本市场发生重大变化且管理人认为将影响各类资产的预期时，管理人将根据实际情况调整资产配置比例。</p> <p>2、基金投资策略在完成资产配置以后，本基金将主要通过优选基金实践资产配置的策略。基金优选策略从定量和定性两大维度展开，对基金及基金公司做出综合性评价。对基金的评价包括风格评价和业绩评价两方面，重点衡量基金风格是否清晰稳定、中长期业绩及风险控制能力是否良好；对基金公司的评价主要从综合实力、管理水平、运作合规等方面进行分析。（1）基金业绩评价和风格评价基于投资范围、投资策略以及实际投资组合等维度，对基金进行分类。本基金以同类基金为对象进行评价，并对各类基金进行评级和排序。考虑的主要因素包括：基金的获利能力：基金与其业绩比较基准的历史回报对比，绩效指标分析（如期间净值增长率、累计净值增长率、分红率等），风险调整后的绩效指标分析（如 Sharpe 比率、Treyner 指标和 Jensen 指标等）；基金的风险衡量：主要考察基金净值波动率、最大回撤、风格偏离等维度。基金的风格：基于合同契约和实际比较基准的拟合等考察基金风格是否清晰。（2）基金公司综合评价对于基金公司的综合评价，依据主要来自于调研、公司刊物和公开信息。考虑的主要因素包括：综合实力：主要包括基金公司的总资产、总资产增长率和加</p>

	<p>权净值收益率；管理水平：主要包括发起人构成、风险控制机制、高级管理人员素质、基金经理的稳定性及从业经验等、研究人员的稳定性及从业经验等。运作合规：主要考察基金管理人或基金经理近 2 年来运作合规情况。本基金将依据基金评价结果，挑选出基础库，并在基础库基础上，依据基金管理公司评价结果及基金评价深度报告、尽调报告等，构建优先库。在基础库和优先库中优选标的，构建本基金组合基金库。基金库将进行定期维护和不定期维护，按照出库入库标准，实现基金库的动态调整。</p> <p>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 A 股和港股的优质的公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1) 自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会；2) 自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势，对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。本基金还将关注以下几类港股通标的：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。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。</p> <p>4、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。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理，并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略，严格遵守法律法规和基金合同的约定，在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。未来，如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可相应调整，不需召开基金份额持有人大会。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可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。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证 800 指数收益率*15%+恒生中国企业指数收益率*5%（经汇率估值调整）+中债综合财富指数收益率*80%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型基金中基金（FOF），其预期风险水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。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。</p>

### 三、基金运作情况

#### 1、基金基本情况

鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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”)《关于准予鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)注册的批复》(证监许可[2020]284 号)批准,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》及其配套规则和《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 381,741,237.54 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0628 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)基金合同》于 2020 年 7 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 381,756,163.42 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,925.88 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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。自 2020 年 7 月 21 日至 2023 年 10 月 16 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”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 5 000 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,基金管理人应当终止《基金合同》,无须召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。”截至 2023 年 10 月 9 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》的约定终止《基金合同》并进入基金财产的清算程序,无须召开基金份额持有人大会审议。

本基金于 2023 年 10 月 10 日在规定媒介就本基金《基金合同》终止及进行基金财产清算的事宜进行了公告,详见《鹏华基金管理有限公司关于鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)基金合同终止及基金财产清算的公告》。

#### 3、清算起始日

本基金从 2023 年 10 月 17 日起进入清算期,清算期间为 2023 年 10 月 17 日至 2023 年 11 月 6 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《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。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：鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2023 年 10 月 16 日

单位：人民币元

资产	最后运作日 2023 年 10 月 16 日
<b>资产：</b>	
银行存款	221,599.93
结算备付金	465.01
存出保证金	20,231.82
交易性金融资产	473,726.95
其中：股票投资	-
基金投资	473,726.95
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	172,709.93
应收利息	-
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	176.82

资产总计	888,910.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>最后运作日</b> <b>2023 年 10 月 16 日</b>
<b>负 债:</b>	
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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	270,124.96
应付赎回费	0.02
应付管理人报酬	219.24
应付托管费	36.55
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	20,000.00
负债合计	290,380.77
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	610,096.30
未分配利润	-11,566.61
所有者权益合计	598,529.69
负债和所有者权益总计	888,910.46

## 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财产中支付。

## 2、资产处置情况

### （1） 备付金、保证金、应收款和其他资产处置情况

序号	项目	最后运作日账面价值	清算金额	清算期末账面价值
1	结算备付金	465.01	0.42	465.43
2	存出保证金	20,231.82	-2,440.11	17,791.71
3	应收证券清算款	172,709.93	-172,709.93	0.00
4	应收利息	-	-	-
5	应收股利	-	-	-
6	应收申购款	-	-	-
7	递延所得税资产	-	-	-
8	其他资产	176.82	-	176.82

### （2） 金融资产处置情况

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	清算期末账面价值
1	股票投资	-	-	-	-
2	基金投资	473,726.95	2023年10月24日	465,310.15	0.00
3	债券投资	-	-	-	-
4	资产支持证券投资	-	-	-	-
5	贵金属投资	-	-	-	-
6	衍生金融资产	-	-	-	-
7	买入返售金融资产	-	-	-	-



## 3、负债清偿情况

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“-”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	应付证券清算款	-	-	-
6	应付赎回款	270,124.96	-270,124.96	0.00
7	应付赎回费	0.02	-0.02	0.00
8	应付管理人报酬	219.24	-219.24	0.00
9	应付托管费	36.55	-36.55	0.00
10	应付销售服务费	-	-	-
11	应付交易费用	-	-	-
12	应交税费	-	-	-
13	应付利息	-	-	-
14	应付利润	-	-	-
15	递延所得税负债	-	-	-
16	其他负债	20,000.00	-	20,000.00

注：其他负债为预提审计费、银行汇划费、银行间账户维护费及账户查询费用。

## 4、清算期的清算损益情况

项目	2023 年 10 月 17 日 至 2023 年 11 月 6 日
----	---------------------------------------

<b>一、收入</b>	-8,295.60
1. 利息收入	121.20
其中：存款利息收入	121.20
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）	-40,108.71
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-40,108.71
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	-
3. 公允价值变动损益（损失以“-”号填列）	31,691.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-
<b>二、费用</b>	-
1. 管理人报酬	
2. 托管费	-
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	-
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-8,295.60
减：所得税费用	-
<b>四、净利润总额（净亏损以“-”号填列）</b>	-8,295.60

## 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2023年10月16日基金净资产	598,529.69
加：清算期间净收益	-8,295.60
加：应付利润结转实收基金金额	-
减：净赎回金额（含费用）	-
二、2023年11月06日基金净资产	590,234.09

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产生的利息归基金份额持有人所有。于清算划款日本基金应收利息余额由基金管理人以自有资金先行垫付，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) 鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）资产负债表及审计报告；
- (2) 关于《鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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。

鹏华聚合多资产 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）财产清算小组

2023 年 11 月 22 日