

# 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	鹏扬中证 500 质量成长	
交易代码	007593	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 8 月 29 日	
报告期末基金份额总额	110,671,428.71 份	
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。	
投资策略	本基金采用被动式指数化投资方法，按照中证 500 质量成长指数中的成份股构成及其权重构建股票投资组合，以跟踪中证 500 质量成长指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。	
业绩比较基准	中证 500 质量成长指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为指数基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。	
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分类基金的基金简称	鹏扬中证 500 质量成长 A	鹏扬中证 500 质量成长 C
下属分类基金的交易代码	007593	007594
报告期末下属分类基金的份额总额	93,608,647.05 份	17,062,781.66 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年4月1日—2020年6月30日）	
	鹏扬中证 500 质量成长 A	鹏扬中证 500 质量成长 C
1. 本期已实现收益	6,194,819.32	1,171,073.33
2. 本期利润	22,465,261.88	4,593,279.17
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2223	0.2080
4. 期末基金资产净值	117,666,791.16	21,346,742.26
5. 期末基金份额净值	1.2570	1.2511

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、本报告所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏扬中证 500 质量成长 A

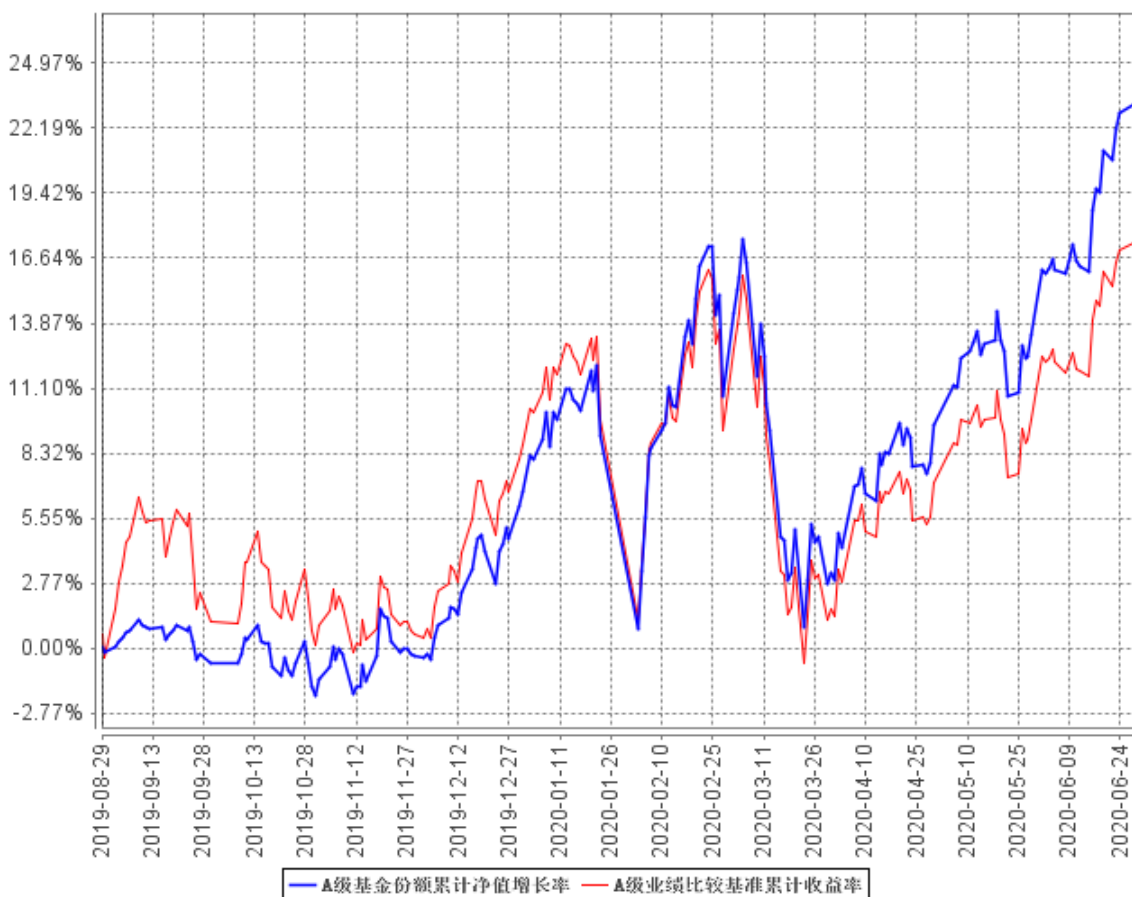
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	21.83%	0.94%	17.61%	0.93%	4.22%	0.01%
过去六个月	17.86%	1.55%	10.07%	1.56%	7.79%	-0.01%
自基金合同生效起至今	25.70%	1.25%	19.57%	1.34%	6.13%	-0.09%

鹏扬中证 500 质量成长 C

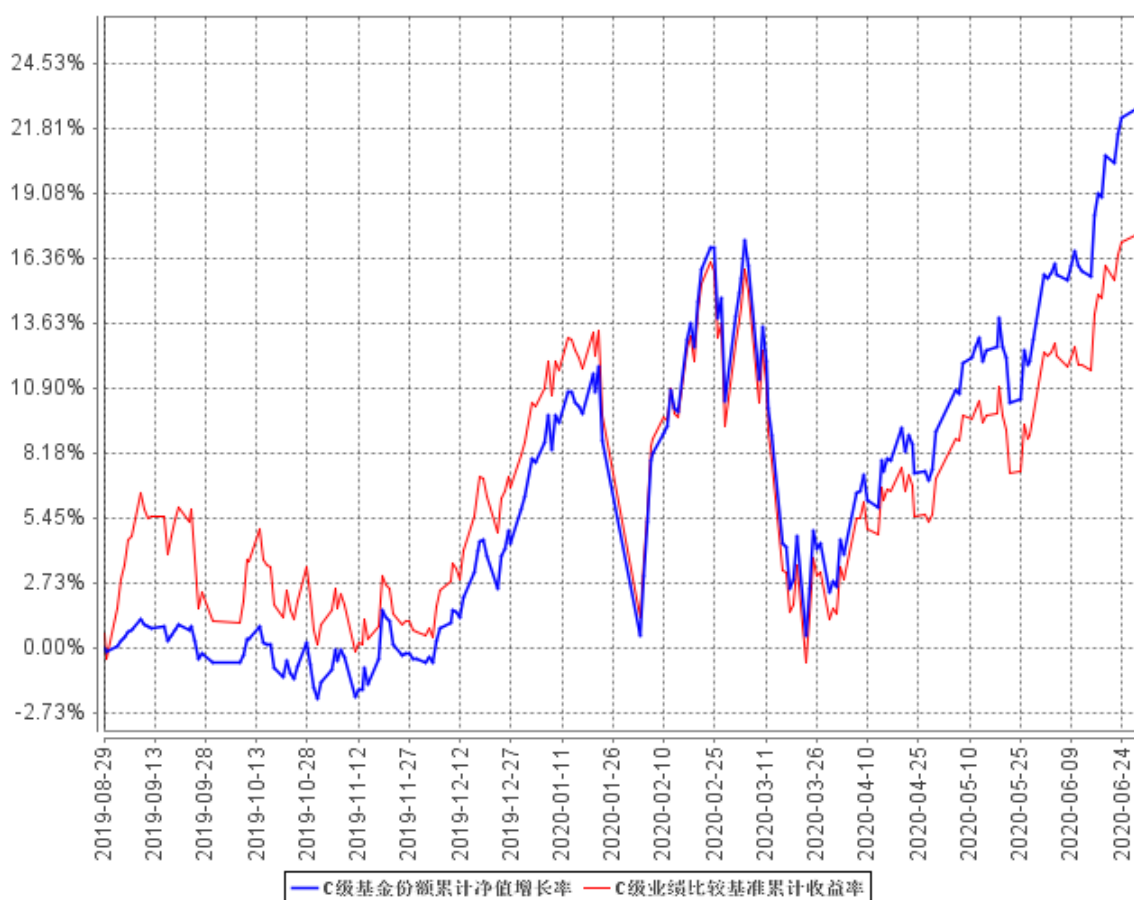
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	21.70%	0.94%	17.61%	0.93%	4.09%	0.01%
过去六个月	17.63%	1.55%	10.07%	1.56%	7.56%	-0.01%
自基金合同生效起至今	25.11%	1.25%	19.57%	1.34%	5.54%	-0.09%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：（1）上图基金净值表现及业绩比较基准截止日期为 2020 年 6 月 30 日。

（2）本基金合同于 2019 年 8 月 29 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

（3）按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围，四、投资限制”的有关规定。

### 3.3 其他指标

注：无

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
施红俊	数量投资部总经理兼指数投资总监	2019 年 8 月 29 日	-	15	同济大学管理学博士，曾任大公国际资信评估有限公司上海分公司中小企业评级部部门经理，中证指数有限公司研究员、固定收益主管、研究开发部副总监。现任鹏扬基金管理有限公司数量投资部总经理兼指数投资总监。2019 年 8 月 29 日至今任鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金经理、2020 年 6 月 9 日至今任鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金经理。

注：1. 此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

为保护投资者利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合。公司根据《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公

司内部规章，拟定了《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》、《鹏扬基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，对公平对待公司管理的各类资产做了明确具体的规定并重视交易执行环节的公平交易措施。本报告期内，本公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度疫情对全球经济的冲击和影响仍在持续，但金融市场对美国和巴西等新兴市场国家持续上升的新增确诊病例的免疫力似乎在提升。我们理解是只要疫情不造成医疗挤兑，随着药物和疫苗的开发，市场相信疫情终将成为过去，但疫情防控长期化常态化对经济活动带来的影响将极为深远。疫情对餐饮旅游娱乐等休闲服务性行业造成持续影响，这些行业的供给和需求均将出现持续收缩；但另一方面，电子商务、游戏、教育、会议等线上数字经济随着疫情蓬勃发展，因此结构性行情成为二季度股市的主旋律。二季度国内疫情防控成效显著、复工复产有序进行，逆周期调节力度加大、各项经济增长指标持续回升，通胀明显回落，流动性合理充裕，陆家嘴论坛释放信号支持资本市场发展（特别是权益类资产），北上资金持续流入，A股市场震荡上升。从风格特征来看，创业板指数涨幅（30.3%）大幅超越中证 500 指数（16.3%）和沪深 300 指数（13.0%），偏价值的上证 50（9.4%）等大盘蓝筹指数继续滞涨。从行业板块来看，免税政策带动的休闲服务、受益全球疫情反复的医疗健康、消费电子、传媒中的游戏板块、新基建推动的计算机等板块大幅上涨，但受国务院让利 1.5 万亿给实体经济政策冲击的金融板块、受南方水灾和财政刺激低于预期的基建板块和偏周期板块则大幅落后市场。

国内货币政策方面，4月3日，央行决定对农联社、农商行、部分城商行等定向降准 1 个百分点，同时自 4 月 7 日起将超额存款准备金利率从 0.72% 下调至 0.35%。二季度下调 1 年期 MLF 中标利率一次 20bp，下调 14 天逆回购中标利率一次 20bp；LPR 利率只在 4 月份进行了调整，1 年期、5 年期分别下调 20bp、10bp。相比海外央行来说，中国央行表现的相当克制。4 月 17 日政治局会议，货币政策新增“运用降准、降息、再贷款等手段”，且继续强调引导贷款市场利率下行。央行 Q1 货币政策报告中货币政策展望部分：“稳健的货币政策更加灵活适度”，继续删除“货币供给总闸门”，删除“坚决不搞大水漫灌”，保留“维护货币政策正常化地位”，政策重心阶段性转移至保增长和保就业，金融风险提法边际淡化。6 月 17 日国常会会议指出，要综合运用降

准、再贷款等工具，保持市场流动性合理充裕。

金融数据方面，4 月末、5 月末社融存量同比增速分别为 12%、12.5%，回升至近 2 年以来新高，显著超出市场预期。其中 4 月社融多增的主要贡献是对实体贷款（同比多增 7506 亿元）和企业债券融资（同比多增 5066 亿元），5 月是政府债券（同比多增 7543 亿元）和对实体贷款（同比多增 3645 亿元）。4 月末和 5 月末，广义货币(M2)余额同比增长均为 11.1%，略低于市场预期，仍为 2017 年以来新高。从结构上来看，4 月企业存款和非银存款是主要贡献（与企业融资同比大幅多增以及 4 月股市回暖逻辑一致），5 月企业存款和居民存款是主要贡献，非银存款则单月减少 6736 亿。4 月末社融和 M2 增速差（0.9%）回落至 2016 年以来新低，5 月末反弹 0.5 个百分点至 1.4%。易纲行长在 6 月 18 日陆家嘴论坛上表示，预计全年新增社融将超过 30 万亿，新增人民币贷款近 20 万亿，估计全年社融增速 12.3%左右。

经济增长方面，在欧美等发达国家货币大放水、财政大刺激的背景下，欧美 4 月的领先经济指标出现了好转迹象，最新公布的 6 月欧美领先经济指标继续回升且好于预期。国内，6 月领先指标制造业 PMI 供需两端（生产和新订单）同步改善，分别比上月上升 0.7 和 0.5 个百分点，其中新订单指数连续两个月回升。6 月非制造业 PMI 建筑业活动指数小幅回落，但连续三个月高于 59.0%，其中与制造业复苏关系较大的生产性服务业景气回升，而面向零售客户的服务业指标仍非常困难。从需求端来看，5 月房地产投资同比 8.1%（3 月 1.1%）、基建投资 10.9%（3 月-8.0%）、制造业投资-5.3%（3 月-20.6%），地产与基建投资仍是需求的主要支撑。向前看，5 月存量施工回补估计已结束，但 1~5 月份新开工项目计划总投资（以基建为主）增长 7.9%，增速加快 6.8 个百分点，预示固定资产投资增速回升的趋势还未结束，但回升斜率趋缓的概率在上升。市场一直担心出口会受到海外疫情的影响低于预期，但由于海外需求受到史无前例的财政货币政策刺激支持短期并未明显下降，出口一直好于市场预期。短期来看，经济活动无论名义还是实际 GDP 预计未来仍是 V 型恢复期。中期来看，由于疫情导致的储蓄倾向上升，中美冲突长期化，全球刺激性政策效应的边际减弱或政策边际上收紧退出，经济仍可能面临再次下行压力，关键观察的时间点可能在第三季度。

通货膨胀方面，5 月全国居民消费价格当月同比回落至 2.4%（3 月为 4.3%），环比连续回落，食品价格回落是主要贡献；5 月工业生产者出厂价格当月同比下降至-3.7%（3 月为-1.5%），环比也连续下降，能源化工行业价格下降是主要贡献。考虑到 PPI 的滞后性，以及 5 月原油现货价格的环比大幅飙升、6 月 PMI 主要原材料购进价格指数 56.8（较 5 月大幅上升 5.2 个百分点），可以预期 6 月 PPI 环比转正、同比回升。央行 Q1 报告提到，从基本面看，我国经济运行总体平稳，总供求基本平衡，不存在长期通胀或通缩的基础。



宏观政策方面，4 月 17 日政治局会议，删掉了此前一直提及的“努力完成全年经济社会发展目标任务”，而对于全面建成小康社会目标任务，由“确保实现”改为“紧扣”，确保完成的目标任务中只保留了“脱贫攻坚”，说明 GDP 翻番目标大概率已淡化。宏观政策力度由“加大”改为“更大”，六稳工作由“全面做好”改为“加大”，且新增了保居民就业等“六保”，意味着逆周期政策力度将进一步加码。2020 年两会政府工作报告中指出：财政赤字、专项债、特别国债三项规模达到 8.51 万亿元，同比提高 3.6 万亿元，可以看出政府应对托底经济、保障六稳的决心；“M2 和社融增速明显高于去年”，“创新直达实体经济的货币政策工具，务必推动企业便利获得贷款”，可以看出宽信用的信号更加清晰。目前来看，宽信用的政策主动退出概率不大，如果退出，市场风格将面临确定性的拐点。

操作上，二季度本基金股票仓位维持在 93%—95% 之间以实现跟踪指数之目标，本基金在报告期内严格按照基金合同和公司风控要求跟踪指数，并做好日常申购、赎回资金安排。此外，本基金积极参与一级市场打新以增厚组合收益。报告期内，本基金实现相对业绩基准的超额收益 4% 以上。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬中证 500 质量成长 A 基金份额净值为 1.2570 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.83%；截至本报告期末鹏扬中证 500 质量成长 C 基金份额净值为 1.2511 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.70%；同期业绩比较基准收益率为 17.61%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	130,041,202.20	92.97
	其中：股票	130,041,202.20	92.97

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,469,525.00	5.34
	其中：债券	7,469,525.00	5.34
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,751,835.05	1.25
8	其他资产	607,388.03	0.43
9	合计	139,869,950.28	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,059,042.00	2.92
C	制造业	84,395,374.00	60.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,670,254.00	1.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,204,469.80	5.18
G	交通运输、仓储和邮政业	2,937,620.00	2.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,894,881.60	4.96
J	金融业	10,020,444.00	7.21
K	房地产业	2,886,622.00	2.08
L	租赁和商务服务业	1,092,375.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,836,730.00	2.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,303,605.00	0.94
R	文化、体育和娱乐业	837,186.00	0.60
S	综合	1,724,898.00	1.24
	合计	128,863,501.40	92.70

注：以上行业分类以 2020 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,015,963.44	0.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,101.92	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	103,635.44	0.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,177,700.80	0.85

注：以上行业分类以 2020 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603444	吉比特	7,400	4,062,674.00	2.92
2	603866	桃李面包	74,300	3,781,127.00	2.72
3	300418	昆仑万维	119,700	2,987,712.00	2.15
4	600298	安琪酵母	52,200	2,582,856.00	1.86
5	002128	露天煤业	318,000	2,464,500.00	1.77
6	601865	福莱特	112,500	2,115,000.00	1.52
7	600529	山东药玻	35,200	2,041,600.00	1.47
8	600901	江苏租赁	380,400	1,981,884.00	1.43
9	603858	步长制药	68,000	1,961,800.00	1.41

10	603338	浙江鼎力	25,740	1,950,319.80	1.40
----	--------	------	--------	--------------	------

### 5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资 明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688085	三友医疗	4,051	273,928.62	0.20
2	688200	华峰测控	1,008	272,180.16	0.20
3	688189	南新制药	2,981	149,676.01	0.11
4	688568	中科星图	5,647	91,537.87	0.07
5	688277	天智航	6,838	82,329.52	0.06

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,361,025.00	5.30
	其中：政策性金融债	7,361,025.00	5.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	108,500.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,469,525.00	5.37

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018007	国开 1801	73,500	7,361,025.00	5.30
2	128115	巨星转债	1,085	108,500.00	0.08

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明 细

注：本基金本报告期期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未参与股指期货投资。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未参与国债期货投资。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

江苏租赁（600901.SH）为鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金的前十大持仓证券。2019 年 9 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局针对江苏金融租赁股份有限公司存在以公益性资产作为租赁物，违规提供融资违法违规事实，处以罚款人民币 50 万元。

本基金投资江苏租赁的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除江苏租赁外，本报告期内本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	79,156.48
2	应收证券清算款	168,395.84
3	应收股利	-
4	应收利息	234,862.18
5	应收申购款	124,973.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	607,388.03

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688568	中科星图	91,537.87	0.07	新股未上市
2	688277	天智航	82,329.52	0.06	新股未上市

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬中证 500 质量成长 A	鹏扬中证 500 质量成长 C
报告期期初基金份额总额	106,101,970.81	29,154,845.15
报告期期间基金总申购份额	7,437,930.79	1,779,798.13
减：报告期期间基金总赎回份额	19,931,254.55	13,871,861.62
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	93,608,647.05	17,062,781.66

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020 年 05 月 18 日-2020 年 06 月 30 日	24,078,947.37	0.00	0.00	24,078,947.37	21.76%

个人	-	-	-	-	-	-
产品特有风险						
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。</p>						

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

鹏扬基金管理有限公司

2020 年 7 月 21 日