

鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证
券投资基金联接基金(原鹏扬中证 500 质量
成长指数证券投资基金)
2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 1 月 20 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 2023 年 1 月 18 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。

自 2022 年 11 月 9 日起，原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金报告期自 2022 年 11 月 9 日至 2022 年 12 月 31 日止。原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金报告期自 2022 年 10 月 1 日起至 2022 年 11 月 8 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(转型后)

2.1.1 基金基本情况

基金简称	鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接
基金主代码	007593
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 9 日
报告期末基金份额总额	570,489,470.26 份
投资目标	通过投资于目标 ETF，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	本基金为目标 ETF 的联接基金，通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金产品投资策略主要包括目标 ETF 投资策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略及其他投资策略。
业绩比较基准	中证 500 质量成长指数收益率×95%+银行活期存款利率(税

	后)×5%	
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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。本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对标的指数的紧密跟踪，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	
下属分级基金的基金简称	鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 A	鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	007593	007594
报告期末下属分级基金的份额总额	362,376,473.69 份	208,112,996.57 份

注：自 2022 年 11 月 9 日起，原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

2.1.2 目标基金基本情况

基金名称	鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	560500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 4 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 9 月 1 日
基金管理人名称	鹏扬基金管理有限公司
基金托管人名称	兴业银行股份有限公司

2.1.3 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法股票投资策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在一般情况下，本基金将根据标的指数的成份股票的构成及其权重构建股票资产组合。此外，本基金的投资策略还包括替代性策略、存托凭证投资策略、债券与资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、融资与转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	中证 500 质量成长指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动投资的交易型开放式指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，具有与标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.2 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(转型前)

2.2.1 基金基本情况

基金简称	鹏扬中证 500 质量成长
基金主代码	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	562,300,311.60 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。本基金的投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略等。	
业绩比较基准	中证 500 质量成长指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×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	
下属分级基金的基金简称	鹏扬中证 500 质量成长 A	鹏扬中证 500 质量成长 C
下属分级基金的交易代码	007593	007594
报告期末下属分级基金的份额总额	352,668,414.12 份	209,631,897.48 份

注：自 2022 年 11 月 9 日起，原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 11 月 9 日 — 2022 年 12 月 31 日）	
	鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 A	鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	-17,731,891.49	-11,386,028.49
2. 本期利润	-32,048,876.54	-18,826,431.56
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0948	-0.0906
4. 期末基金资产净值	568,700,150.90	321,849,018.69
5. 期末基金份额净值	1.5694	1.5465

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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) 自 2022 年 11 月 9 日起，原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

3.1.2 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 10 月 1 日 — 2022 年 11 月 8 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	2,578,306.78	1,418,828.99
2. 本期利润	21,864,045.04	12,918,368.46
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0610	0.0597
4. 期末基金资产净值	585,793,060.12	343,334,854.16
5. 期末基金份额净值	1.6610	1.6378

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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) 自 2022 年 11 月 9 日起，原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

3.2 基金净值表现

3.2.1 鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金（转型后）

（报告期：2022 年 11 月 9 日-2022 年 12 月 31 日）

3.2.1.1 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 ETF 联接 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
自基金转型起至今	-5.51%	0.88%	-5.03%	0.87%	-0.48%	0.01%

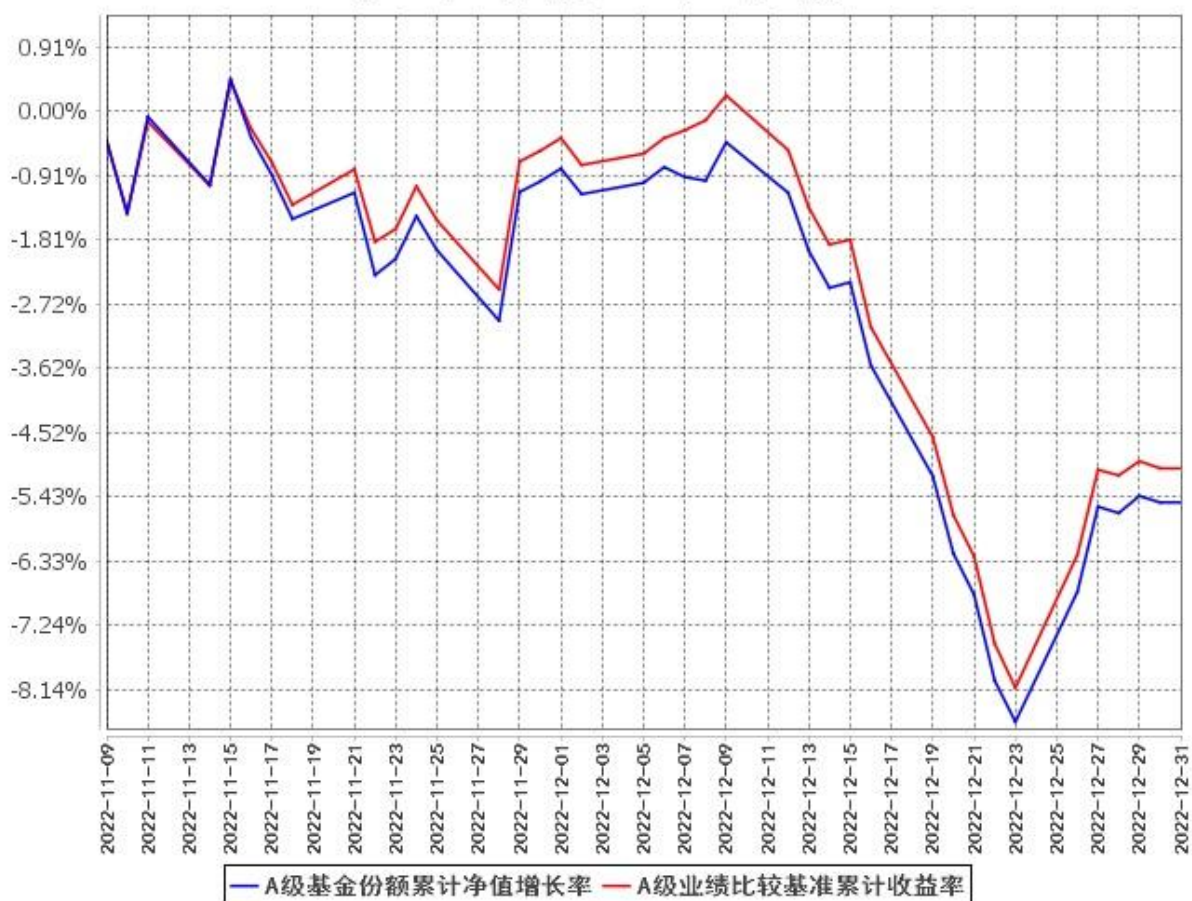
鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 C

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
----	--------	---------------	----------------	-------------------	-----	-----

自基金转型起至今	-5.57%	0.88%	-5.03%	0.87%	-0.54%	0.01%
----------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

3.2.1.2 自基金转型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级基金自转型以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型后）
(2022年11月9日至2022年12月31日)



**C级基金自转型以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型后）
（2022年11月9日至2022年12月31日）**



注：(1)自 2022 年 11 月 9 日起，原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。本基金转型后截至报告期末基金合同生效未满一年。

(2)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。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

3.2.2 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(转型前)

(报告期：2022 年 10 月 1 日-2022 年 11 月 8 日)

3.2.2.1 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 (2022年8月 9日-2022年 11月8日)	-4.38%	1.31%	-4.75%	1.29%	0.37%	0.02%
过去六个月 (2022年5月	6.76%	1.28%	3.91%	1.26%	2.85%	0.02%

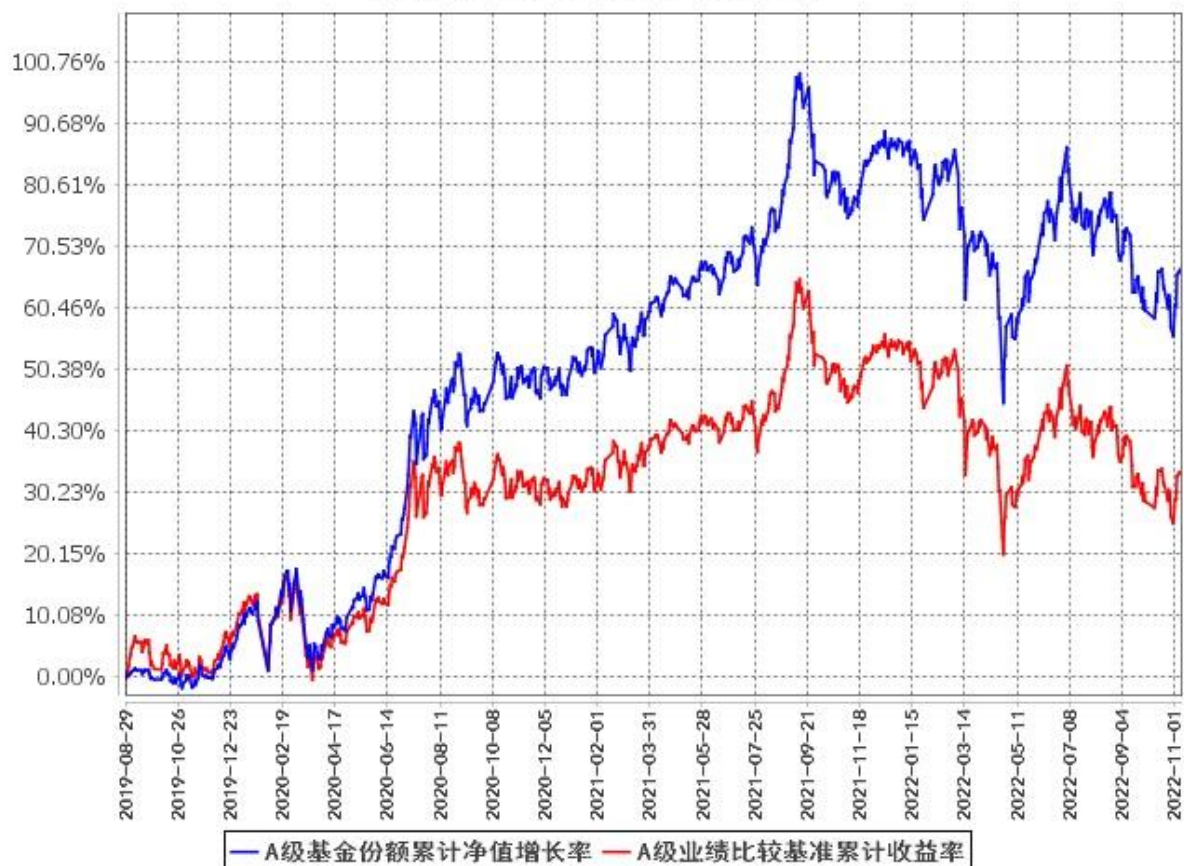
9 日-2022 年 11 月 8 日)						
过去一年 (2021 年 11 月 9 日-2022 年 11 月 8 日)	-5.53%	1.37%	-8.52%	1.35%	2.99%	0.02%
过去三年 (2019 年 11 月 9 日-2022 年 11 月 8 日)	66.58%	1.28%	30.69%	1.27%	35.89%	0.01%
自基金合同生效起至 2022 年 11 月 8 日	66.10%	1.24%	33.03%	1.26%	33.07%	-0.02%

鹏扬中证 500 质量成长 C

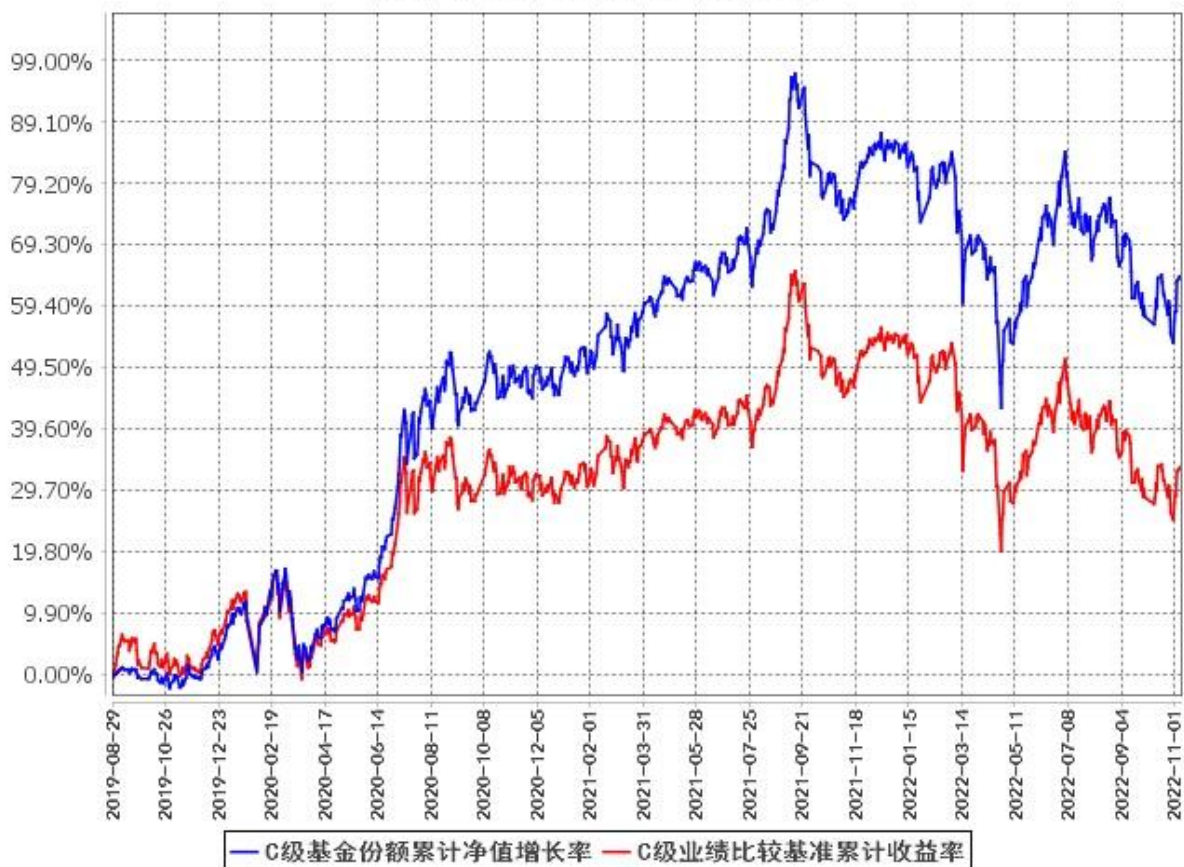
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月 (2022 年 8 月 9 日-2022 年 11 月 8 日)	-4.47%	1.31%	-4.75%	1.29%	0.28%	0.02%
过去六个月 (2022 年 5 月 9 日-2022 年 11 月 8 日)	6.55%	1.28%	3.91%	1.26%	2.64%	0.02%
过去一年 (2021 年 11 月 9 日-2022 年 11 月 8 日)	-5.90%	1.37%	-8.52%	1.35%	2.62%	0.02%
过去三年 (2019 年 11 月 9 日-2022 年 11 月 8 日)	64.45%	1.28%	30.69%	1.27%	33.76%	0.01%
自基金合同生效起至 2022 年 11 月 8 日	63.78%	1.24%	33.03%	1.26%	30.75%	-0.02%

3.2.2.2 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级自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型前）
(2019年8月29日至2022年11月8日)



C级自基金合同生效以来基金份额净值变动情况及与同期业绩比较基准的变动比较图（转型前）
（2019年8月29日至2022年11月8日）



注：自 2022 年 11 月 9 日起，原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

4.1.1 鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(转型后)

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	本基金基金经理,数量投资部总经理兼指数投资总监	2022 年 11 月 9 日	-	17	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

				<p>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 2022 年 11 月 8 日任鹏扬中证 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；2021 年 5 月 25 日至今任鹏扬沪深 300 质量成长低波动指数证券投资基金基金经理；2021 年 7 月 16 日至 2022 年 11 月 30 日任鹏扬中证科创创业 50 指数证券投资基金基金经理；2021 年 8 月 4 日至今任鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 22 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 4 月 27 日至今任鹏扬中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理；2022 年 9 月 26 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理；2022 年 10 月 26 日至今任鹏扬中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2022 年 11 月 9 日至今任鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理；2022 年 12 月 1 日至今任鹏扬中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.2 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(转型前)

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	本基金基金经理,数量投资部总经理兼指数投资总监	2019 年 8 月 29 日	2022 年 11 月 8 日	17	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 2022 年 11 月 8 日任鹏扬中证 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;2021 年 5 月 25 日至今任鹏扬沪深 300 质量成长低波动指数证券投资基金基金经理;2021 年 7 月 16 日至 2022 年 11 月 30 日任鹏扬中证科创创业 50 指数证券投资基金基金经理;2021 年 8 月 4 日至今任鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2021 年 12 月 22 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理;2022 年 4 月 27 日至今任鹏扬中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理;2022 年 9 月 26 日至今任鹏扬中证数字经济主题交易型开放式指数证券投资基

					金发起式联接基金基金经理；2022 年 10 月 26 日至今任鹏扬中证科创创业 50 交易型开放式指数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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年 4 季度，全球经济延续放缓态势，欧美制造业 PMI 处在收缩区间，外向型经济主体的出口增速大幅下滑。美国通胀连续两月超预期回落，释放了需求进一步走弱的信号，但劳动力市场同期依然紧俏，通胀顽固的风险犹存。4 季度美联储逐步放缓加息步伐，分别在 11 月和 12 月加息 75bp 和 50bp，预计 2023 年定调为小幅加息后维持高位。在美联储加息风险回落、欧洲能源危机缓解以及中国疫情防控放开等因素的驱动下，美元指数持续走弱，明显缓解了对全球风险资产的压制。

2022 年 4 季度，国内经济呈现“弱现实、强预期”的特征，制造业 PMI 连续回落，疫情冲击和

外需回落是主要原因。往前看，疫情防控与地产政策均出现系统性变化，宏观系统性风险降低，预计 2023 年将出台一系列提振内需的政策，经济见底回升的方向明确，居民与企业对政策的信心及响应程度将决定经济回升的幅度。通货膨胀方面，4 季度国内 CPI 同比整体回落，猪肉价格环比由升转降，其他重要商品及服务涨价压力依然较弱，反映了疲弱的内需以及能源保供政策对稳定能源价格的作用。在大宗商品价格回落及高基数的背景下，4 季度国内 PPI 同比加速回落。流动性方面，人民银行下调存款准备金率 25bp；11 月的理财赎回潮导致了资金面边际收紧，央行随后加大资金投放力度，资金利率重回低位。当前，央行宽松政策的基调未变，但操作精细化程度提升。信用扩张方面，信贷结构边际改善，政府债发行量回落，政策性金融工具主导的基建投资带动了中长期贷款需求的回暖，但是居民按揭仍然疲弱。11 月以来，信用利差的走扩对企业进行债券融资产生了较大的压制。

2022 年 4 季度，海外股市呈现倒 V 型走势，纳斯达克指数下跌了 1.03%，标普 500 指数上涨了 7.08%，道琼斯工业指数上涨了 15.39%。10 月和 11 月，通胀和加息风险的降低大幅提振了市场情绪。进入 12 月，市场从乐观情绪逐渐转向了对盈利的担忧，引发了股市的显著回调。4 季度，国内股市整体表现略弱于海外市场。10 月中下旬，A 股受悲观预期影响出现了明显的下跌，后续伴随地产和疫情政策的转向而迅速反弹。从风格来看，10 月份小盘明显跑赢大盘，成长相对跑赢价值；11 月初是一个分水岭，市场风格逆转且分化加剧，非消费的成长板块弱势调整，价值板块以及受益于疫情放开的消费行业则有明显的反弹，期间大盘也明显跑赢小盘。4 季度，沪深 300 指数上涨 1.75%，中证 500 指数上涨 2.63%，500 质量指数下跌 1.87%，500 质量指数相对跑输中证 500 指数的原因一方面在于当期样本超配上游周期，但上游周期在 4 季度整体表现相对较弱，另一方面在于 4 季度“困境反转”更贴合市场主线，但 500 质量指数的因子选择逻辑与“困境反转”相悖。从行业板块来看，表现较好的主要是社服商贸、食品饮料等受益于疫情放开的板块以及计算机、传媒等受益于自主可控政策的板块。

操作方面，本基金本报告期内严格按照基金合同要求跟踪指数，并做好日常申购、赎回资金安排和指数调样工作，同时积极参与一级市场打新以增厚组合收益。

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 ETF 联接 A(转型后)的基金份额净值为 1.5694 元，2022 年 11 月 9 日至 2022 年 12 月 31 日基金份额净值增长率为-5.51%；截至本报告期末鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 C(转型后)的基金份额净值为 1.5465 元，2022 年 11 月 9 日至 2022 年 12 月 31 日基金份额净值增长率为-5.57%；同期业绩比较基准收益率为-5.03%。

截至 2022 年 11 月 8 日，鹏扬中证 500 质量成长 A(转型前)的基金份额净值为 1.6610 元，2022 年 8 月 9 日至 2022 年 11 月 8 日基金份额净值增长率为-4.38%；鹏扬中证 500 质量成长 C(转型前)的基金份额净值为 1.6378 元，2022 年 8 月 9 日至 2022 年 11 月 8 日基金份额净值增长率为-4.47%；同期业绩比较基准收益率为-4.75%。

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 鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(转型后)

(报告期：2022 年 11 月 9 日-2022 年 12 月 31 日)

5.1.1 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	2,566,335.64	0.28
	其中：股票	2,566,335.64	0.28
2	基金投资	844,051,521.20	93.27
3	固定收益投资	48,938,341.94	5.41
	其中：债券	48,938,341.94	5.41
	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	8,313,361.29	0.92
8	其他资产	1,125,363.95	0.12
9	合计	904,994,924.02	100.00

5.1.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	鹏扬中证 500 质量成长 ETF	股票型	交易型开放式	鹏扬基金管理有 限公司	844,051,521.20	94.78

5.1.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.3.1 报告期末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	2,248,435.33	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	233,342.26	0.03
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	27,251.35	0.00
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	51,702.20	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,566,335.64	0.29

5.1.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

5.1.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.1.4.1 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

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	688409	富创精密	4,814	460,459.10	0.05
2	603799	华友钴业	7,150	397,754.50	0.04
3	688231	隆达股份	7,835	275,321.90	0.03
4	002906	华阳集团	7,000	232,540.00	0.03
5	688372	伟测科技	2,383	193,499.60	0.02
6	688498	源杰科技	1,582	178,971.66	0.02
7	301269	华大九天	973	85,565.62	0.01

8	688455	科捷智能	5,277	71,819.97	0.01
9	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
10	688292	浩瀚深度	4,503	66,059.01	0.01

5.1.5 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	48,938,341.94	5.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	48,938,341.94	5.50

5.1.6 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	019679	22 国债 14	251,000	25,272,089.73	2.84
2	019666	22 国债 01	180,350	18,399,479.94	2.07
3	019674	22 国债 09	52,000	5,266,772.27	0.59
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.1.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

5.1.12 投资组合报告附注

5.1.12.1 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

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.1.12.2 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。

5.1.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	327,066.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	798,297.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,125,363.95

5.1.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.12.5 报告期末前十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	688409	富创精密	460,459.10	0.05	新股锁定期流通受限
2	688231	隆达股份	275,321.90	0.03	新股锁定期流通受限
3	688372	伟测科技	193,499.60	0.02	新股锁定期流通受限
4	688498	源杰科技	178,971.66	0.02	新股锁定期流通受限
5	301269	华大九天	85,565.62	0.01	新股锁定期流通受限
6	688292	浩瀚深度	66,059.01	0.01	新股锁定期流通受限

5.1.12.6 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。

5.2 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(转型前)

(报告期: 2022 年 10 月 1 日-2022 年 11 月 8 日)

5.2.1 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	889,965,641.50	94.05
	其中: 股票	889,965,641.50	94.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,663,423.19	5.25
	其中: 债券	49,663,423.19	5.25
	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	1,212,213.20	0.13
8	其他资产	5,455,498.34	0.58
9	合计	946,296,776.23	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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	119,994,156.08	12.91
C	制造业	533,015,777.98	57.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,373,024.00	0.79
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,758,852.68	2.88
G	交通运输、仓储和邮政业	37,418,084.00	4.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,379,708.68	3.27
J	金融业	83,468,913.20	8.98
K	房地产业	10,943,334.00	1.18
L	租赁和商务服务业	5,770,044.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	15,397,731.00	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	5,492,257.80	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	8,317,167.00	0.90
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	884,329,050.42	95.18

5.2.2.2 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	1,365,065.00	0.15
C	制造业	3,787,088.25	0.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	398,831.36	0.04
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	28,916.65	0.00
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	50,936.82	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,753.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,636,591.08	0.61

5.2.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

5.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.2.3.1 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	600256	广汇能源	3,157,400	33,973,624.00	3.66
2	601615	明阳智能	947,390	24,205,814.50	2.61
3	300769	德方纳米	59,180	18,531,625.20	1.99

4	000983	山西焦煤	1,434,100	17,524,702.00	1.89
5	603605	珀莱雅	98,520	17,337,549.60	1.87
6	300390	天华超净	245,800	17,255,160.00	1.86
7	300724	捷佳伟创	113,400	16,261,560.00	1.75
8	002497	雅化集团	533,100	15,806,415.00	1.70
9	600233	圆通速递	816,200	15,466,990.00	1.66
10	300012	华测检测	747,100	15,397,731.00	1.66

5.2.3.2 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	600938	中国海油	84,004	1,365,065.00	0.15
2	688409	富创精密	4,814	600,450.22	0.06
3	300207	欣旺达	18,900	488,187.00	0.05
4	603799	华友钴业	7,150	473,258.50	0.05
5	002920	德赛西威	3,000	373,050.00	0.04

5.2.4 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	49,528,400.11	5.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	135,023.08	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,663,423.19	5.35

5.2.5 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	019679	22 国债 14	239,000	24,065,538.60	2.59
2	019666	22 国债 01	198,470	20,203,457.56	2.17
3	019674	22 国债 09	52,000	5,259,403.95	0.57
4	113659	莱克转债	1,350	135,023.08	0.01
5	-	-	-	-	-

5.2.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	141,133.31
2	应收证券清算款	3,255,056.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,059,308.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,455,498.34

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.2.11.5.1 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

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。

5.2.11.5.2 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	688409	富创精密	600,450.22	0.06	新股锁定期流通受限

5.2.11.6 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

6.1 鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(转型后)

单位：份

项目	鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 A	鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接 C
基金合同生效日基金份额总额	352,668,414.12	209,631,897.48
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	50,837,897.83	13,212,586.27
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	41,129,838.26	14,731,487.18
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	362,376,473.69	208,112,996.57

注：(1)总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

(2)本基金合同于 2022 年 11 月 9 日生效。

(3)自 2022 年 11 月 9 日起，原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

6.2 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(转型前)

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	356,330,901.66	223,042,501.77
报告期期间基金总申购份额	11,337,246.49	9,842,859.18
减：报告期期间基金总赎回份额	14,999,734.03	23,253,463.47

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	352,668,414.12	209,631,897.48

注：(1) 总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

(2) 自 2022 年 11 月 9 日起，原鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

§ 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

7.1.1 鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(转型后)

本报告期内基金管理人未持有本基金。

7.1.2 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(转型前)

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

7.2.1 鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(转型后)

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。

7.2.2 鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(转型前)

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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；
2. 《鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；
3. 《鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；
4. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
6. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

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

2023 年 1 月 20 日