鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金
2021年年度报告

2021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

送出日期：2022年3月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2022年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 6
2.1 基金基本情况 6
2.2 基金产品说明 6
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 12
§4 管理人报告 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 21
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 21
§5 托管人报告 21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 22
§6 审计报告 22
6.1 审计报告基本信息 22
6.2 审计报告的基本内容 22
§7 年度财务报表 24
7.1 资产负债表 24
7.2 利润表 25

7.3 所有者权益（基金净值）变动表 26
7.4 报表附注 27
§8 投资组合报告 62
8.1 期末基金资产组合情况 62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 62
8.3 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 64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 76
8.6 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 76
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 76
8.8 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 76
8.9 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 76
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 77
8.12 投资组合报告附注 77
§9 基金份额持有人信息 78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 78
§10 开放式基金份额变动 79
§11 重大事件揭示 79
11.1 基金份额持有人大会决议 79
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 79
11.4 基金投资策略的改变 79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 79
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 80
11.8 其他重大事件 81
§12 影响投资者决策的其他重要信息 84
12.1 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 84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 85
§13 备查文件目录 85
13.1 备查文件目录 85

13.2 存放地点 85
13.3 查阅方式 85

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	512,160,621.91 份	
基金合同存续期	不定期	
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	336,180,876.72 份	175,979,745.19 份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		鹏扬基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宋震	吴玉婷
	联系电话	010-68105888	021-52629999-212052
	电子邮箱	service@pyamc.com	xywyt@cib.com.cn
客户服务电话		400-968-6688	95561
传真		010-68105966	021-62159217

注册地址	中国(上海)自由贸易试验区栖霞路120号3层302室	福州市湖东路154号
办公地址	北京市西城区复兴门外大街A2号中化大厦16层	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码	100045	200120
法定代表人	杨爱斌	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.pyamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
注册登记机构	鹏扬基金管理有限公司	北京市西城区复兴门外大街A2号中化大厦16层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年		2020年		2019年8月29日(基金合同生效日)-2019年12月31日	
	鹏扬中证500质量成长A	鹏扬中证500质量成长C	鹏扬中证500质量成长A	鹏扬中证500质量成长C	鹏扬中证500质量成长A	鹏扬中证500质量成长C
本期已实现收益	56,769,315.62	33,075,852.69	36,224,028.94	8,145,770.78	3,059,107.51	1,335,428.97
本期利润	82,774,515.05	34,397,669.86	37,600,315.36	6,975,841.83	8,396,219.39	3,043,169.13
加权平均基金份额本期利润	0.3825	0.2651	0.3927	0.3080	0.0576	0.0326

本期加权平均净值利润率	21.70%	15.18%	30.58%	24.71%	5.73%	3.25%
本期基金份额净值增长率	26.40%	25.89%	39.46%	38.91%	6.65%	6.36%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	229,956,656.28	117,036,086.11	32,207,656.39	6,425,340.48	2,394,817.08	837,838.29
期末可供分配基金份额利润	0.6840	0.6651	0.4297	0.4196	0.0229	0.0201
期末基金资产净值	631,975,697.91	327,305,594.80	111,490,151.83	22,623,012.39	111,704,386.44	44,399,961.09
期末基金份额净值	1.8799	1.8599	1.4873	1.4774	1.0665	1.0636
3.1.3 累计期末指标	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	87.99%	85.99%	48.73%	47.74%	6.65%	6.36%

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)期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

(3)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 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

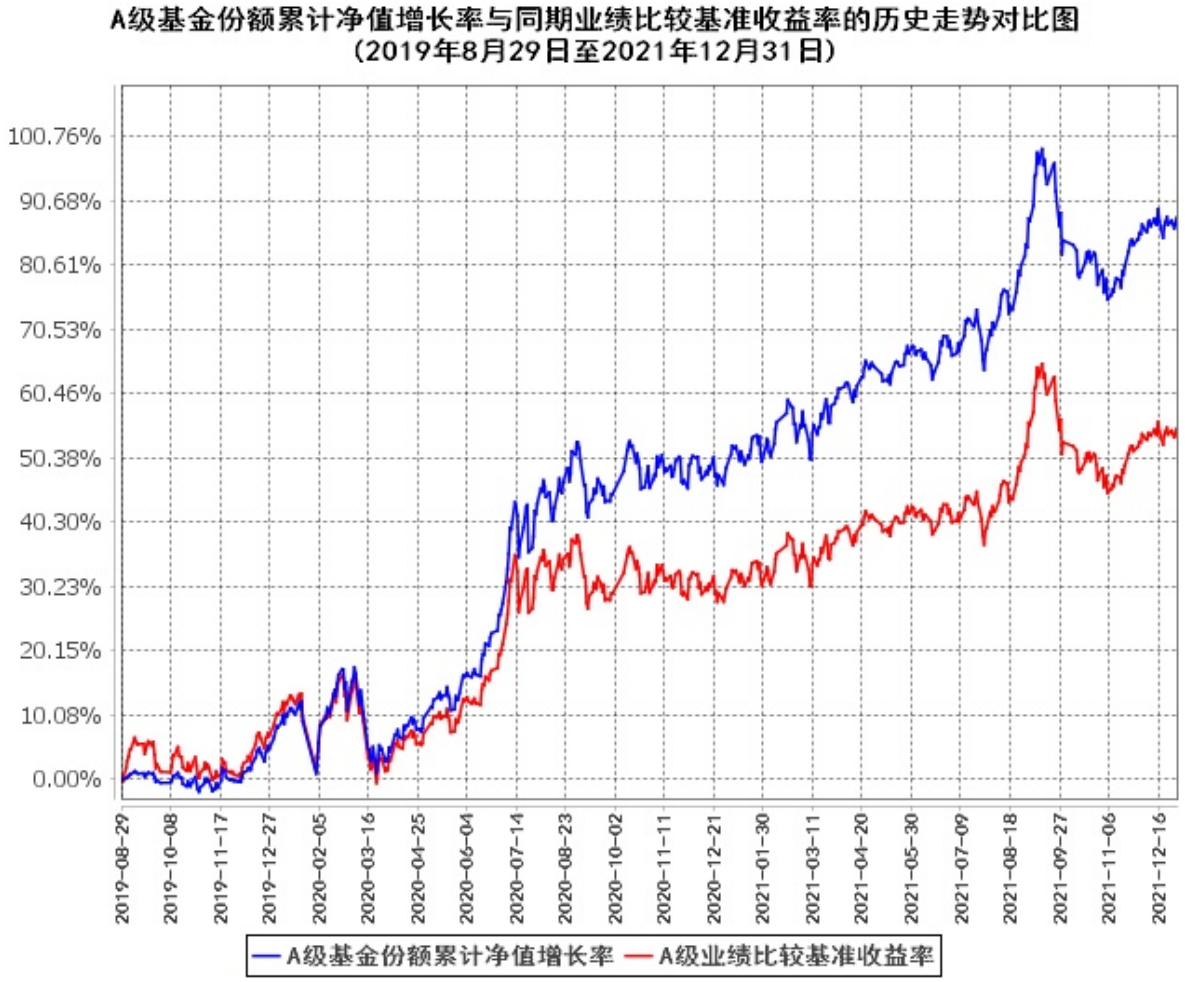
鹏扬中证500质量成长A

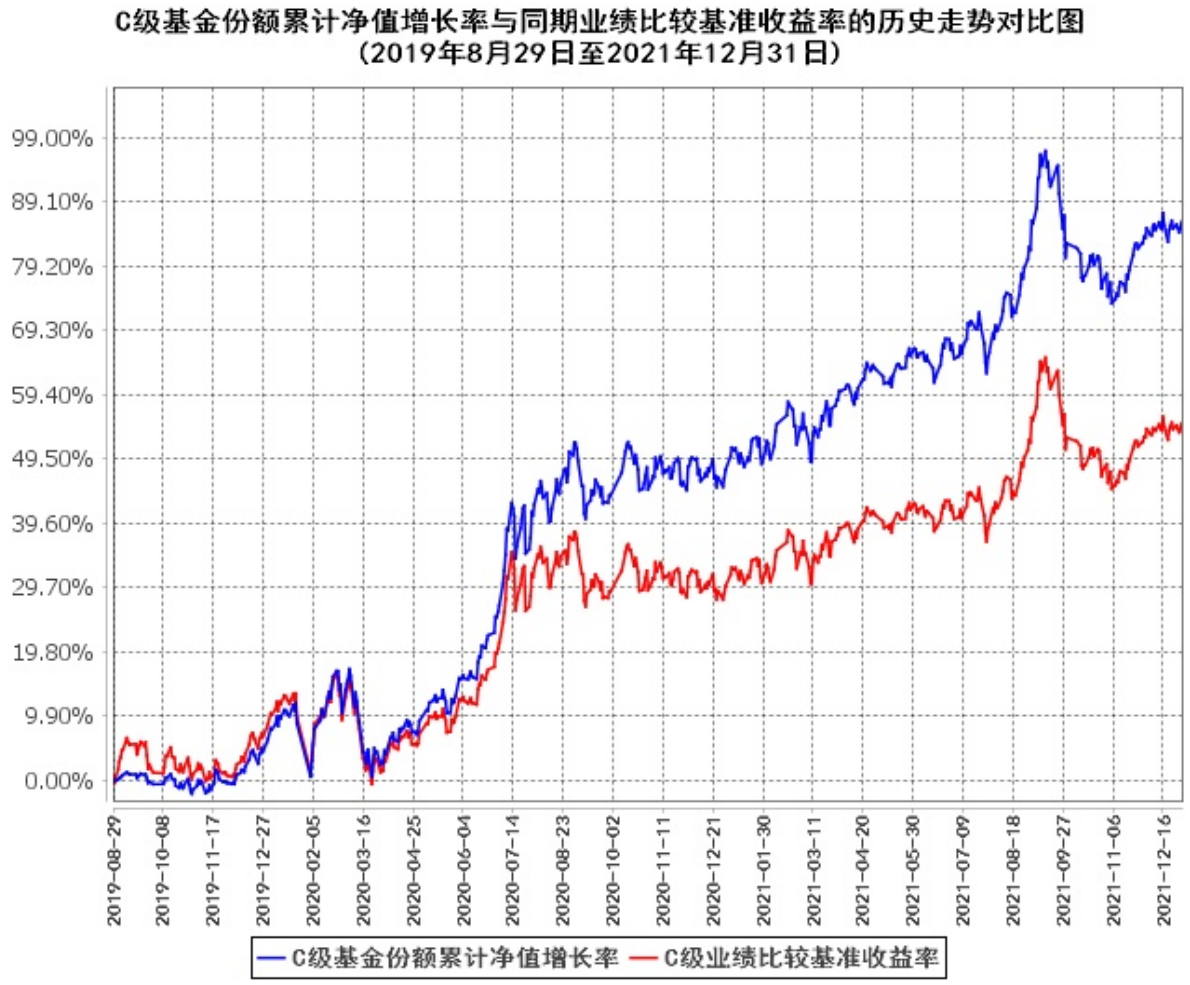
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.94%	0.78%	1.44%	0.77%	0.50%	0.01%
过去六个月	11.45%	1.00%	8.94%	1.01%	2.51%	-0.01%
过去一年	26.40%	0.94%	19.33%	0.95%	7.07%	-0.01%
自基金合同生效起至今	87.99%	1.15%	54.93%	1.19%	33.06%	-0.04%

鹏扬中证500质量成长C

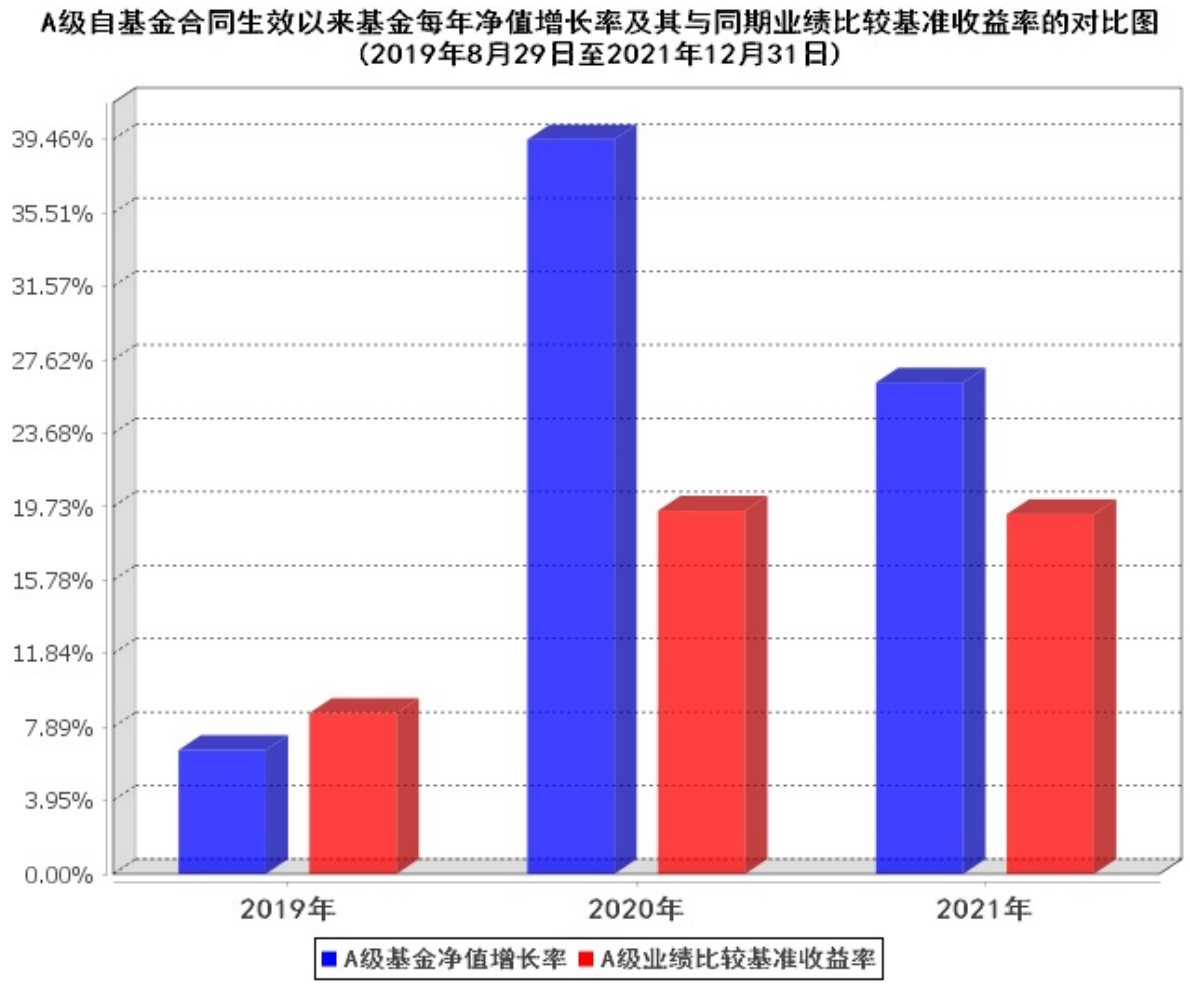
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.83%	0.78%	1.44%	0.77%	0.39%	0.01%
过去六个月	11.23%	1.00%	8.94%	1.01%	2.29%	-0.01%
过去一年	25.89%	0.94%	19.33%	0.95%	6.56%	-0.01%
自基金合同生效起至今	85.99%	1.15%	54.93%	1.19%	31.06%	-0.04%

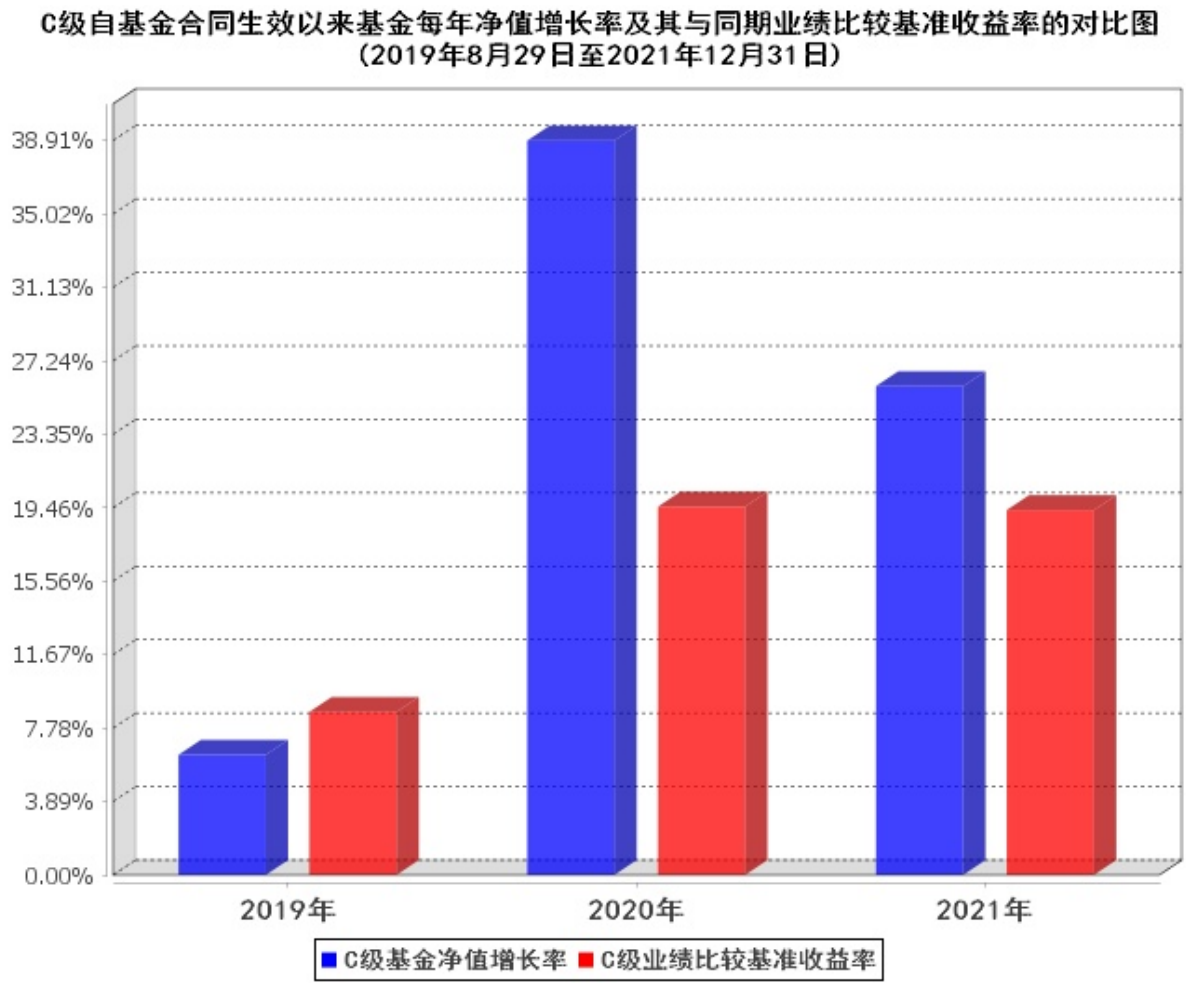
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较




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
(2019年8月29日至2021年12月31日)
99.00%
89.10%
79.20%
69.30%
59.40%
49.50%
39.60%
29.70%
19.80%
9.90%
0.00%
2019-08-29
2019-10-08
2019-11-17
2019-12-27
2020-02-05
2020-03-16
2020-04-25
2020-06-04
2020-07-14
2020-08-23
2020-10-02
2020-11-11
2020-12-21
2021-01-30
2021-03-11
2021-04-20
2021-05-30
2021-07-09
2021-08-18
2021-09-27
2021-11-06
2021-12-16
C级基金份额累计净值增长率
C级业绩比较基准收益率

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金合同于 2019 年 8 月 29 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏扬基金管理有限公司(以下简称“鹏扬基金”)成立于 2016 年 7 月 6 日，是经中国证监会批准成立的国内首家“私转公”基金管理公司，注册地在上海，主要办公地在北京，已在北京、上海、深圳成立分公司。

公司以“为客户创造价值，为美好生活助力”为使命，秉持“客户至上、勇于担当、拥抱变化、合作共赢”的价值观，以“专业稳健，回报信任”作为经营宗旨。公司持续巩固“固定收益+”的特

色，绩优主动股票和精品指数业务齐头并进。公司的长远目标是成为在中国资本市场上有影响力的、能持续为客户创造价值的专业化资产管理公司。在专业人士持股的治理机制下，客户利益、股东利益以及管理者的利益高度一致，使得公司能够更加专注于长期目标，不会被短期利益所裹挟，从而保障了我们能够在公募行业中行稳致远。

鹏扬基金致力于建立行业领先的投研体系，不断强化投研能力，汇聚海内外优秀人才，核心投资人员均具有10年以上头部金融机构工作经历，为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。公司建立了固收、股票、指数量化、多资产四大团队，固收团队持续提升宏观研究与资产配置、信用研究、衍生品对冲的三大避险能力，力求为投资人获取长期、稳健的收益；股票团队致力于做深度的个股研究和产业研究，遵循自下而上的基本面理念严选个股，同时充分保留基金经理自己的风格特点；指数团队聚焦高质量核心资产，深挖面向未来的行业主题，努力为投资者提供具有长期良好持有体验的指数产品；多资产团队将基于大数据的定量研究和基于调研访谈的定性研究有机结合，为投资者提供便捷的FOF组合方案，有效分散投资风险，助力资产稳健增值。同时，鹏扬基金注重风险管理，从文化上树立全员风险防范意识；从制度上实现风险管理在投前、投中、投后的全流程覆盖；从结果上检验风险管理成效，杜绝风险事件的发生；从科技手段上，公司自主研发的“基于大数据的智能投资与风险管理平台”已入围证监会首批资本市场金融科技创新项目。

凭借优异的投资业绩，鹏扬基金2021年获评《证券时报》颁发的第十六届中国基金业明星基金奖“三年持续回报明星基金公司”，在公募行业内，仅3家基金公司获此殊荣。截至2021年12月31日，鹏扬基金旗下公募基金数量增长到56只，公司资产管理总规模接近1400亿元，非货公募规模接近900亿元。根据海通证券研究所金融产品研究中心基金业绩评价报告，截至2021年12月31日，鹏扬基金最近三年权益产品投资业绩排名行业第5。

鹏扬基金将专业精神与社会责任相结合，在不同维度积极履行企业社会责任，获得官方机构和专业媒体的广泛认可。2021年是我国国债恢复发行40周年。在财政部国库司和《中国财经报》联合组织的纪念征文中，鹏扬基金作品荣获三等奖，是唯一获奖的基金公司作品，展现了公募基金公司作为国债市场重要参与者的担当精神和专业水平。2021年，鹏扬基金积极参与全国银行间本币市场的市场共建，履行社会责任，在银行间市场党建、培训、公益等方面取得一定的成绩，获得由全国银行间同业拆借中心颁发的“年度市场影响力奖”。此外，鹏扬基金积极投身巩固拓展脱贫攻坚成果、持续推进乡村振兴的国家战略，参与第一财经公益基金会“一份早餐”计划，为云南怒江山区小学师生捐赠爱心早餐，该项目2021年获得由《中国基金报》颁发的第三届公募基金英华奖“最佳公益实践”奖项。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	-	16	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；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 日至今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。

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遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》，内容主要包括公平交易的原则、投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易行为分析、监控与评估及公平交易行为的信息披露。

公平交易制度所规范的范围涵盖公司旗下各类资产组合，围绕投资管理活动包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易(含银行间市场)等，贯穿授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

在投资决策的内部控制方面，通过建立规范的投资决策机制与健全的投资授权制度、共享研究资源为投资人员提供公平的投资机会。本基金管理人内控要求投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，投资人员根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等建立不同投资组合的投资对象备选库并在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

在交易执行的内部控制方面，本基金管理人建立集中交易制度。交易系统具备执行公平交易的功能，对交易所公开竞价交易，交易系统自动启用公平交易功能，合理分配各投资指令的执行。对银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配、综合平衡的原则对交易结果进行分配。

在行为监控与分析评估方面，本基金管理人建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。公司严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。对于旗下投资组合之间(纯被动指数组合和量化投资组合除外)确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据并经过事前审批后方可交易，并留存记录备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《鹏扬基金管理有限公司公平交易制度》，公平对待旗下管理的所有基金及其它组合。

本基金管理人通过统计检验的方法对本年度公司旗下管理的所有投资组合，在不同时间窗口下(1日内、3日内、5日内)同向交易的价差进行了专项分析，包括旗下各大类资产组合之间的同向交

易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下组合存在违反公平交易的情况。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年全球经济总体处于分步复苏阶段，全年来看，疫情反复和宏观政策是影响各国经济增长的最重要因素。上半年，受益于疫苗接种提速和各国政府推出的宽松货币政策和积极财政政策支持，全球经济复苏进程明显加快。由于供给端受疫情影响恢复较慢，而需求端在政策刺激下恢复较快，全球通货膨胀短期压力明显上升，主要体现在生产国中上游工业品价格和消费国消费品价格的大幅上涨。下半年，随着主要经济体逐步进入扩张周期和通货膨胀压力上升，部分国家开始逐步退出疫情期间的极度宽松政策。受“德尔塔”、“奥密克戎”等新冠病毒变异冲击及全球货币财政政策边际收紧等多重因素影响，全球经济出现高位放缓迹象，同时受芯片短缺、海运费和上游原材料价格大涨等供给冲击因素影响，全球制造业动能不断走弱。随着商品和服务涨价扩散，美国单位劳动力成本开始明显上涨，西方国家主要矛盾已经由应对疫情的经济、就业冲击转为应对通货膨胀，部分发达与新兴市场国家开始加息，美联储正式宣布宽松货币政策的退出，全球主要央行进入加息周期。

2021年中国经济增速8.1%，1至4季度GDP同比分别增长18.3%、7.9%、4.9%、4.0%，两年平均分别增长4.9%、5.5%、4.9%、5.2%，经济总体保持平稳运行。上半年经济运行积极因素较多，主要受超预期的出口增长和房地产投资增长支持；下半年面临“供给冲击、需求收缩、预期转弱”三重压力，下行压力不断加大。通货膨胀方面，受猪肉价格大幅下跌、疫情反复制约服务价格上涨和经济下行总需求不足等因素影响，全年CPI上涨0.9%，涨幅比2020年回落1.6个百分点，总体运行在合理区间。受地方政府运动式减碳等政策影响，中上游大宗商品供给严重不足，叠加上年低基数效应，工业品出厂价格(PPI)由上年下降1.8%转为大幅上涨8.1%。但受城镇居民可支配收入增速回落和边际消费倾向不足影响，PPI向CPI传导并不顺畅，PPI和CPI背离不断加大，且背离持续高位时间拉长。

流动性方面，2021年上半年央行主要通过灵活适度的公开市场操作保持流动性合理充裕，并通过再贷款和两项直达工具，在引导货币信贷增长回到常态的同时，优化信贷结构和降低融资成本。

下半年，面对经济下行的三重压力，央行通过全面降准、降低公开市场政策利率、推出碳减排支持工具和清洁能源再贷款等宽松政策支持实体经济，货币市场流动性呈现偏宽松局面。信用扩张方面，2021年初1-2月社会融资总量增速仍超市场预期保持在较高水平；3月起受票据短贷、企业债、政府债、非标的压缩影响，社会融资规模存量增速开始快速回落；进入下半年，受房地产市场大幅下滑影响，实体信贷明显走弱，同时受房地产和地方政府融资平台等非标融资延续收缩及政府债去年基数高等因素共同拖累，社会融资总量增速回落到10.3%的较低水平，信用收缩较快，对总需求扩张带来明显不利影响。12月广义货币供应量增速回落到8%-9%的偏低水平，考虑到2021年名义GDP水平较2020年有大幅回升，金融市场超额流动性明显下降。

2021年股票市场继续保持结构性牛市格局，但行业指数分化严重。代表大盘价值风格的上证50指数下跌10.06%，沪深300指数下跌5.20%。代表中小盘成长风格的创业板指数和中小100指数分别上涨12.02%和4.62%。本基金的跟踪指数中证500质量成长指数上涨20.35%，中证500上涨15.58%。从行业板块来看，受益于“碳达峰和碳中和”等政策支持和新能源车渗透率不断提升的电力设备和新能源行业以及受益于价格大幅上涨的钢铁、基础化工、有色金属、公用事业等传统周期行业涨幅居前。受房地产政策收紧和疫情反复冲击的家用电器、非银金融、房地产、社会服务、食品饮料等行业跌幅居前。此外，港股方面，受到“反垄断和防止资本无序扩张”等行业监管政策影响的互联网龙头公司市值均大幅缩水。2021年债券市场则先抑后扬，呈现牛市格局。

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，股票仓位大部分时间维持在94%~95%之间以实现跟踪指数之目标，并做好日常申购、赎回资金安排，同时积极参与一级市场打新以增厚组合收益。

4.4.2 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的基金份额净值为1.8799元，本报告期基金份额净值增长率为26.40%；截至本报告期末鹏扬中证500质量成长C的基金份额净值为1.8599元，本报告期基金份额净值增长率为25.89%；同期业绩比较基准收益率为19.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，我们认为宏观政策、疫情防控和地缘政治冲突是影响全球经济金融市场的三个关键因素。由于在疫情防控和宏观经济政策应对方面的明显差异，当前全球经济影响力最大的中国和美国在经济周期方面并不同步，宏观经济和政策组合将明显分化。目前美国经济增长、就业形势良好，通货膨胀压力不断上升，经济主要矛盾是“胀”，宏观政策组合将转为财政货币双收缩。中国经济受“三重压力”影响，经济下行压力加大，但消费物价水平较低，工业品价格在保供稳价政策出

台后稳中有降，通货膨胀压力不大，经济主要矛盾是“滞”，宏观政策组合将转为财政货币双宽松。我们认为中美两国宏观政策组合的力度、节奏和效果对全球资本市场走势有着非常重要的影响。疫情防控方面，由于“奥密克戎”病毒的高传染和低毒性的特点，全球主要国家疫情形势有向好趋势，各国防疫政策出现放宽趋势或全面取消防疫限制，如果疫情能在今年顺利结束“大流行”，毫无疑问，这对深受疫情冲击的全球供应链、线下经济活动恢复有很大的正面效应；但风险是如果新病毒变种出现，疫情反复叠加政策转向将对全球经济造成巨大影响。地缘政治冲突方面，我们认为北约东扩与俄罗斯国家安全底线矛盾，中美两国全面展开激烈竞争引发的贸易、科技冲突以及潜在的金融和其他层面的冲突风险都在不断上升，这可能会给2022年的资本市场带来巨大的波动。

展望2022年中国经济，我们认为1季度仍面临一定的下行压力，主要是疫情反复造成的消费需求较弱和房地产市场大幅回落导致的投资需求较弱。但由于政策已经全面转向“稳增长”，预计随着1季度财政政策前置发力和宽松货币政策支持，经济环比数据将在2季度迎来明显提升，经济同比增长数据有望在前3季度逐季回升。全年来看，中国经济仍有望实现5%-6%的平稳增长。我们认为主要有三方面因素驱动经济企稳回升：第一，供给方面，由于中央明确提出“要把稳增长放在更加突出的位置”和重回“以经济建设为中心”，在碳减排和碳达峰等长期结构性目标上提出“先立后破”，同时强劲出口增长可能受海外供给恢复和政策收紧等因素影响回落，上游原材料价格逐步回落将有利于中下游工业生产活动的逐步恢复。第二，需求方面，我们认为造成2021年需求收缩的主要原因是财政后置“紧财政”和房地产、地方政府融资平台“去杠杆”导致的“紧信用”。但在2022年，财政政策要在1季度形成实物工作量，适度前置，“紧财政”转为“宽财政”；房地产要保障居民部门的合理购房需求，“紧信用”转为“稳信用”，围绕“碳减排”方面的绿色能源“加杠杆”，宏观杠杆率预计将由2021年明显收缩转为企稳回升。第三，预期转弱方面，2021年围绕“共同富裕”和“防止资本无序扩张”等长期目标，政策部门出台加强教育、医疗、互联网平台经济等一系列行业监管政策对私人部门的投资信心造成较大冲击。但在2021年年底中央经济工作会议上明确指出，共同富裕“首先要通过全国人民共同奋斗把蛋糕做大做好，然后通过合理的制度安排把蛋糕切好分好”。中央的表态如果结合实质性的纠偏政策出台，相信市场信心也会逐步回升。

通货膨胀方面，我们认为中美通胀水平可能会出现较大差异。美国通胀压力较大，主要原因是商品与服务涨价压力扩散、单位劳动成本上升、通胀预期升温，工资-物价螺旋上升的风险不断增加。随着国内双碳政策纠偏、美国货币财政收紧、欧美国家力图控制通胀，大宗商品的涨势将遭遇逆风，预计PPI同比将逐步回落。由于能繁母猪产能充足、耐用消费品涨价压力减弱，服务业成本中的房租与农民工工资上涨乏力，预计CPI同比回升幅度将较温和，PPI与CPI剪刀差将收窄。全年CPI同比高点预计在3季度达到3%左右，全年平均CPI预计仍保持在2%左右的温和水平，通货膨胀风险不

大。

流动性方面，我们认为2022年货币政策总体基调是“宽货币和宽信用”，为稳定经济增长和对冲房地产企业的流动性压力，央行将继续通过公开市场操作、降息降准等政策工具保持流动性合理充裕，降低实际融资成本，提升信贷需求。信用扩张方面，我们认为上半年随着政策全面转向稳增长，预计社会融资总量增速将回升到10.5%以上，全年宏观杠杆率有望上升7%左右。值得注意的是，由于房地产销售和投资仍面临政策限制和长期拐点等制约，本轮稳增长周期的信用扩张程度预计将较为温和。考虑到2022年名义GDP同比增速较上年明显回落，但广义货币供应在“宽财政和宽信用”支持下逐步回升，这意味以M2-名义GDP衡量的金融市场流动性将较2021年宽松，总体对资本市场是向有利方向演变。流动性方面主要的风险是外部美元超预期加息或缩表导致的海外流动性冲击。我们认为由于疫情后中国商品出口高增长和服务贸易逆差减少，经常项目积累巨大的外汇收入，这部分外汇中有相当部分以美元存款存放于商业银行并未结汇，这在一定程度上能缓解美元加息、资本外流的流动性冲击风险。此外，中国作为全球少数具备较大的财政和货币政策空间的大型经济体，中国资本市场与海外资本市场的弱相关性导致极端情况下，中国资本市场可能反而受益于海外央行激进紧缩政策造成的金融市场短期剧烈波动。

展望2022年股票市场，我们预计市场仍将以结构性行情为主，大级别指数级行情在政策没有超预期的前提下仍难以看到。从经济基本面来看，利空因素是短期经济增长下行压力仍存在，上市公司整体盈利增速将有所放缓；利多因素是2021年12月份的中央经济工作会议重提“以经济建设为中心”，宏观政策全面转向“稳增长”，虽然市场一直对稳增长政策的执行力度保持怀疑，但我们认为稳增长政策只会迟到、不会缺席，政策执行将逐步兑现“稳增长”预期，政策效果在2、3季度将逐步显现。从流动性和估值水平来看，随着央行降准降息政策落地，无风险利率水平明显下行，提升了风险资产的风险溢价水平。此外，伴随信用扩张逐步恢复和宏观杠杆率企稳回升，股票市场整体估值将有所扩张。从行业结构和市场风格特征来看，我们认为近两年一直受到疫情和政策压制的“低估值”传统经济板块，譬如银行、建筑建材、家电家具与大众消费品等行业的盈利将触底恢复，同时在稳增长政策不断发力的背景下将面临较大的估值修复机会。相反，近3年显著受益于“高质量发展”政策支持的“高景气”优质成长经济板块，虽然盈利水平仍将维持高增长，但受估值水平偏高、交易头寸拥挤、海外成长股因美国货币政策紧缩出现估值收缩等多重不利因素影响，其风险收益比下降，存在阶段性调整风险。但在经济转型和高质量发展的长期大背景下，我们认为新能源、半导体、军工、汽车智能化、工业自动化等相关行业领域的阶段性调整可能也孕育着非常好的长线布局机会。股票市场如果出现超预期的下行风险，我们认为可能情景是：1)目前房地产市场大幅回落是制约经济需求回升的主要因素，如果房地产政策应对出现明显失误，将引发系统性经济金融风

险；2)外部美国通货膨胀风险不断上升，美联储货币政策激进收缩引发海外金融市场剧烈波动，进而对国内市场，尤其是估值水平偏高的“高景气”赛道股带来较大的短期冲击风险。

展望2022年债券市场，我们认为机会不大、风险有限，收益率水平预计维持窄幅震荡。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控内幕交易和坚守“三条底线”,进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门传达最新法规和监管要求，并对公司业务的影响进行解读，将各项要求落实到具体责任部门，使得公司从业人员知法、守法。二是建立覆盖业务全环节的合规监控体系，严格事前、事中、事后的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、投资交易管理、基金信息披露、基金运营、IT保障以及反洗钱等业务环节。不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，完善信息隔离和利益冲突管理制度机制。三是开展合规宣导和合规培训，建立合规风控考评机制，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过定期向员工传递合规简报，开展对新员工的入职合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专题合规培训，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和风险的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部得到有效落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，向董事会报送监察稽核季报。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的投研、交易、运营专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控机制，采用系统监控结合日常定期抽查等有效手段，监督投资管理人员的个人行为，防范出现违反监管法规或公司规章的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，依据最新监管要求和公司业务开展情况，梳理相关业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

监管报备及信息披露方面，严格按照监管法规要求完成管理人层面、基金层面的监管报备及信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时，充分保障持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会(成员包括公司分管领导以及投资研究部、监察稽核部、交易管理部、基金运营部等部门负责人及相关业务骨干，估值委员会成员中不包括基金经理)。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2022)审字第 61290365_A19 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

	在编制财务报表时，管理层负责评估鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理层计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	王珊珊　　王海彦
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	301,463.16	59,043.78
结算备付金		896,204.61	141,912.89
存出保证金		166,217.24	46,439.99
交易性金融资产	7.4.7.2	960,750,687.26	135,458,927.62
其中：股票投资		908,179,776.96	128,172,104.02
基金投资		-	-
债券投资		52,570,910.30	7,286,823.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		772,118.02	1,058,501.47
应收利息	7.4.7.5	1,049,529.80	111,702.93
应收股利		-	-
应收申购款		1,232,319.27	70,566.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		965,168,539.36	136,947,094.90
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021年12月31日**	**上年度末 2020年12月31日**
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,000,000.00	400,000.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,204,826.99	1,965,112.50
应付管理人报酬		368,939.76	53,522.43
应付托管费		81,986.60	11,893.88
应付销售服务费		115,503.02	8,486.14
应付交易费用	7.4.7.7	870,132.82	174,323.65
应交税费		0.26	-

应付利息		-88.77	-340.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	245,945.97	220,932.85
负债合计		5,887,246.65	2,833,930.68
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	512,160,621.91	90,272,094.45
未分配利润	7.4.7.10	447,120,670.80	43,841,069.77
所有者权益合计		959,281,292.71	134,113,164.22
负债和所有者权益总计		965,168,539.36	136,947,094.90

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额512,160,621.91份，其中鹏扬中证500质量成长A基金份额净值1.8799元，基金份额总额336,180,876.72份；鹏扬中证500质量成长C基金份额净值1.8599元，基金份额总额175,979,745.19份。

7.2 利润表

会计主体：鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
一、收入		125,098,291.60	46,814,190.32
1.利息收入		873,967.66	272,267.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	43,707.12	19,521.85
债券利息收入		811,857.13	233,227.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		18,403.41	19,517.30
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		95,127,771.19	45,815,891.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	81,872,961.65	43,706,406.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	458,544.48	369,267.53
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	12,796,265.06	1,740,217.82
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	27,327,016.60	206,357.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列）			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,769,536.15	519,674.30
减：二、费用		7,926,106.69	2,238,033.13
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	2,723,191.44	680,913.80
2．托管费	7.4.10.2.2	605,153.63	151,314.17
3．销售服务费	7.4.10.2.3	905,021.44	113,940.21
4．交易费用	7.4.7.19	3,171,640.49	880,064.70
5．利息支出		102,272.77	17,585.84
其中：卖出回购金融资产支出		102,272.77	17,585.84
6．税金及附加		0.06	1.20
7．其他费用	7.4.7.20	418,826.86	394,213.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		117,172,184.91	44,576,157.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		117,172,184.91	44,576,157.19

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏扬中证500质量成长指数证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	90,272,094.45	43,841,069.77	134,113,164.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	117,172,184.91	117,172,184.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	421,888,527.46	286,107,416.12	707,995,943.58
其中：1.基金申购款	968,530,202.18	696,333,611.82	1,664,863,814.00
2.基金赎回款	-546,641,674.72	-410,226,195.70	-956,867,870.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	512,160,621.91	447,120,670.80	959,281,292.71

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	146,480,976.05	9,623,371.48	156,104,347.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,576,157.19	44,576,157.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-56,208,881.60	-10,358,458.90	-66,567,340.50
其中：1.基金申购款	147,799,405.85	41,985,401.87	189,784,807.72
2.基金赎回款	-204,008,287.45	-52,343,860.77	-256,352,148.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	90,272,094.45	43,841,069.77	134,113,164.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨爱斌	崔雁巍	韩欢
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(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[2019]376 号《关于准予鹏扬中证 500 质量成长指数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 2019 年 7 月 25 日至 2019 年 8 月 26 日向社会公开募集，首次募集的有效净认购金额为人民币 302,941,765.01 元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 93,714.71 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2019)验字第 61290365_A13 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2019 年 8 月 29 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 303,035,479.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 93,714.71 份基金份额，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为鹏扬基金管理有限公

司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证 500 质量成长指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册的上市股票、存托凭证)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于中证 500 质量成长指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更基金投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号<年度报告的内容与格式>》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》及其他中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为贷款和应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。贷款和应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5)回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。 由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额，扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(4)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(5)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6)衍生工具收益/(损失)于股指期货合约平仓和到期交割日确认，并按平仓和到期交割日成交

金额与其成本的差额，扣除适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

(7)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(8)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若投资人选择红利再投资方式进行收益分配，收益的计算以权益除权日当日收市后计算的各类基金份额净值为基准转为相应类别的基金份额进行再投资；

(2)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3)本基金的同一类别的每份基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

(4)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债

券的转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称“资管产品运营业务”)，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017] 90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。对证券投资基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息红利继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	301,463.16	59,043.78
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	301,463.16	59,043.78

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		873,545,804.14	908,179,776.96	34,633,972.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	52,626,657.01	52,570,910.30	-55,746.71
	银行间市场	-	-	-
	合计	52,626,657.01	52,570,910.30	-55,746.71
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		926,172,461.15	960,750,687.26	34,578,226.11
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		120,884,835.11	128,172,104.02	7,287,268.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	7,322,883.00	7,286,823.60	-36,059.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,322,883.00	7,286,823.60	-36,059.40
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		128,207,718.11	135,458,927.62	7,251,209.51

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	160.60	34.05
应收定期存款利息	-	-

应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	443.63	70.29
应收债券利息	1,048,843.29	111,575.60
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	82.28	22.99
合计	1,049,529.80	111,702.93

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	870,132.82	174,323.65
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	870,132.82	174,323.65

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	548.95	932.85
应付证券出借违约金	-	-
指数使用费	50,397.02	50,000.00
预提费用	195,000.00	170,000.00
合计	245,945.97	220,932.85

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏扬中证500质量成长A	
项目	本期

	2021年1月1日至 2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	74,958,997.60	74,958,997.60
本期申购	442,900,343.31	442,900,343.31
本期赎回(以"-"号填列)	-181,678,464.19	-181,678,464.19
本期末	336,180,876.72	336,180,876.72

金额单位：人民币元

鹏扬中证500质量成长C		
项目	本期 2021年1月1日至 2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,313,096.85	15,313,096.85
本期申购	525,629,858.87	525,629,858.87
本期赎回(以"-"号填列)	-364,963,210.53	-364,963,210.53
本期末	175,979,745.19	175,979,745.19

注：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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏扬中证500质量成长A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,207,656.39	4,323,497.84	36,531,154.23
本期利润	56,769,315.62	26,005,199.43	82,774,515.05
本期基金份额交易产生的变动数	140,979,684.27	35,509,467.64	176,489,151.91
其中：基金申购款	241,920,024.97	70,308,450.14	312,228,475.11
基金赎回款	-100,940,340.70	-34,798,982.50	-135,739,323.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	229,956,656.28	65,838,164.91	295,794,821.19

单位：人民币元

鹏扬中证500质量成长C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,425,340.48	884,575.06	7,309,915.54
本期利润	33,075,852.69	1,321,817.17	34,397,669.86
本期基金份额交易产生的变动数	77,534,892.94	32,083,371.27	109,618,264.21
其中：基金申购款	283,269,623.62	100,835,513.09	384,105,136.71
基金赎回款	-205,734,730.68	-68,752,141.82	-274,486,872.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,036,086.11	34,289,763.50	151,325,849.61

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
活期存款利息收入	19,062.57	9,335.60
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	22,667.29	8,993.67
其他	1,977.26	1,192.58
合计	43,707.12	19,521.85

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
卖出股票成交总额	985,685,577.76	343,986,965.67
减：卖出股票成本总额	903,812,616.11	300,280,559.48
买卖股票差价收入	81,872,961.65	43,706,406.19

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,610,212.20	18,341,880.21
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,786,763.79	17,562,361.49
减：应收利息总额	364,903.93	410,251.19
买卖债券差价收入	458,544.48	369,267.53

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	12,796,265.06	1,740,217.82
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	12,796,265.06	1,740,217.82

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
1.交易性金融资产	27,327,016.60	206,357.47
——股票投资	27,346,703.91	241,799.68
——债券投资	-19,687.31	-35,442.21
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	27,327,016.60	206,357.47

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
基金赎回费收入	1,748,580.60	507,812.90
基金转换费收入	20,955.55	11,820.52
其他	-	40.88
合计	1,769,536.15	519,674.30

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
交易所市场交易费用	3,171,640.49	880,064.70
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,171,640.49	880,064.70

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
审计费用	75,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	200,397.02	200,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	5,429.84	6,213.21
合计	418,826.86	394,213.21

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏扬基金管理有限公司(“鹏扬基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金代销机构
杨爱斌	基金管理人股东
上海华石投资有限公司	基金管理人股东
宏实资本管理有限公司	基金管理人股东
上海济通企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海璞识企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海润京企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海泓至企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日 至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日 至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,723,191.44	680,913.80
其中：支付销售机构的客户维护费	640,955.16	110,773.92

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.45%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.45%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	605,153.63	151,314.17

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.10%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏扬中证 500 质量成长 A	鹏扬中证 500 质量成长 C	合计
鹏扬基金	-	86,431.21	86,431.21
兴业银行	-	7,443.41	7,443.41
合计	-	93,874.62	93,874.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏扬中证 500 质量成长 A	鹏扬中证 500 质量成长 C	合计
鹏扬基金	-	26,638.46	26,638.46
兴业银行	-	11,983.81	11,983.81
合计	-	38,622.27	38,622.27

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.40%/当年天数

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	301,463.16	19,062.57	59,043.78	9,335.60

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688772	珠海冠宇	2021年9月30日	2022年4月15日	新股锁定期流通受限	14.43	39.09	12,960	187,012.80	506,606.40	-
688211	中科微至	2021年10月18日	2022年4月26日	新股锁定期流通受限	90.20	71.32	4,351	392,460.20	310,313.32	-
688766	普冉股份	2021年8月12	2022年2月23	新股锁定	148.90	342.73	704	104,825.60	241,281.92	-

		日	日	期流通受限						
688285	高铁电气	2021年10月12日	2022年4月20日	新股锁定期流通受限	7.18	9.14	15,159	108,841.62	138,553.26	-
688210	统联精密	2021年12月20日	2022年6月27日	新股锁定期流通受限	42.76	39.53	2,218	94,841.68	87,677.54	-
688718	唯赛勃	2021年7月20日	2022年1月28日	新股锁定期流通受限	5.85	27.71	3,145	18,398.25	87,147.95	-
688799	华纳药厂	2021年7月5日	2022年1月13日	新股锁定期流通受限	30.82	40.73	1,917	59,081.94	78,079.41	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股锁定期流通受限	60.66	96.75	749	45,434.34	72,465.75	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定期流通受限	116.88	116.08	515	60,193.20	59,781.20	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定期流通受限	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股锁定期流通受限	93.09	75.34	672	62,556.48	50,628.48	-
301090	华润	2021年	2022年	新股	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-

	材料	10月19日	4月26日	锁定期流通受限						
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定期流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定期流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股锁定期流通受限	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定期流通受限	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定期流通受限	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定期流通受限	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定期流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定期流通受限	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-

301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定期流通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定期流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股锁定期流通受限	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定期流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股锁定期流通受限	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定期流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股锁定期流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股锁定期流通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	新股锁定期流通受	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-

				限						
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定期流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股锁定期流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股锁定期流通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股锁定期流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股锁定期流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	新股锁定期流通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股锁定期流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定期流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股锁定期流	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-

				通受限						
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定期流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定期流通受限	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定期流通受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定期流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定期流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定期流通受限	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股锁定期流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定期流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
300774	倍杰特	2021年7月26	2022年2月16	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-

		日	日	期流通受限						
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股锁定期流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股锁定期流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股锁定期流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定期流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股锁定期流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股锁定期流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定期流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股锁定期流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301133	金钟	2021年	2022年	新股	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-

	股份	11月19日	5月26日	锁定期流通受限						
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定期流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定期流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股锁定期流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定期流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定期流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定期流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股锁定期流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股锁定期流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-

301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股锁定期流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定期流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股锁定期流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定期流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定期流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定期流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定期流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股锁定期流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股锁定期流通受	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-

				限						
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定期流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股锁定期流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股锁定期流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定期流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定期流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市流通受限	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市流通受限	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
871245	威博液压	2021年12月24日	2022年1月6日	新股未上市流	9.68	9.68	200	1,936.00	1,936.00	-

				通受限						

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113634	珀莱转债	2021年12月9日	2022年1月4日	新债未上市流通受限	100.00	100.00	370	37,000.00	37,000.00	-

注：以上部分证券的“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额1,000,000.00元，于2022年1月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人通过制定政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理思想融入公司整体组织架构的设计中，从而实现全方位、多角度风险

管理，确保产品风险暴露不超越投资者的风险承受能力。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。基金经理、风险管理部、交易管理部、基金运营部以及监察稽核部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理。从投资决策制定层面，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理。从投资决策执行层面，风险管理部、交易管理部与基金运营部对投资交易与交收的合规风险、操作风险等风险进行管理。从风险监控层面，公司督察长、风险管理人员及监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、风险管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告。

同时，本基金管理人采用科学的风险管理分析方法对组合面对的投资风险进行分析，主要通过定性分析和定量分析的方法，评估各种金融工具的风险及可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据基金资产所投资的不同金融工具的特征，制定相关风险量化指标及模型，并通过日常量化分析报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	53,582,747.75	7,398,399.20

合计	53,582,747.75	7,398,399.20

注：(1)债券评级取自第三方评级机构(不含中债资信评估有限责任公司)的债项评级。

(2)未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、短期融资券、公司债等。

(3)债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	37,005.84	-
未评级	-	-
合计	37,005.84	-

注：(1)债券评级取自第三方评级机构(不含中债资信评估有限责任公司)的债项评级。

(2)未评级债券包括国债、政策性金融债、央票、地方政府债、中期票据、公司债等。

(3)债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金管理人通过限制投资集中度、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“7.4.12期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通

过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	301,463.16	-	-	-	301,463.16
结算备付金	896,204.61	-	-	-	896,204.61
存出保证金	166,217.24	-	-	-	166,217.24
交易性金融资产	52,533,910.30	-	37,000.00	908,179,776.96	960,750,687.26
应收证券清算款	-	-	-	772,118.02	772,118.02
应收利息	-	-	-	1,049,529.80	1,049,529.80
应收申购款	-	-	-	1,232,319.27	1,232,319.27
资产总计	53,897,795.31	-	37,000.00	911,233,744.05	965,168,539.36
负债					
卖出回购金融资产款	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	3,204,826.99	3,204,826.99
应付管理人报酬	-	-	-	368,939.76	368,939.76
应付托管费	-	-	-	81,986.60	81,986.60
应付销售服务费	-	-	-	115,503.02	115,503.02
应付交易费用	-	-	-	870,132.82	870,132.82
应付利息	-	-	-	-88.77	-88.77
应交税费	-	-	-	0.26	0.26
其他负债	-	-	-	245,945.97	245,945.97
负债总计	1,000,000.00	-	-	4,887,246.65	5,887,246.65
利率敏感度缺口	52,897,795.31	-	37,000.00	906,346,497.40	959,281,292.71
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	59,043.78	-	-	-	59,043.78
结算备付金	141,912.89	-	-	-	141,912.89
存出保证金	46,439.99	-	-	-	46,439.99
交易性金融资产	7,286,823.60	-	-	128,172,104.02	135,458,927.62
应收证券清算款	-	-	-	1,058,501.47	1,058,501.47
应收利息	-	-	-	111,702.93	111,702.93
应收申购款	-	-	-	70,566.22	70,566.22
资产总计	7,534,220.26	-	-	129,412,874.64	136,947,094.90
负债					
卖出回购金融资产款	400,000.00	-	-	-	400,000.00
应付赎回款	-	-	-	1,965,112.50	1,965,112.50
应付管理人报酬	-	-	-	53,522.43	53,522.43
应付托管费	-	-	-	11,893.88	11,893.88
应付销售服务费	-	-	-	8,486.14	8,486.14
应付交易费用	-	-	-	174,323.65	174,323.65
应付利息	-	-	-	-340.77	-340.77
其他负债	-	-	-	220,932.85	220,932.85
负债总计	400,000.00	-	-	2,433,930.68	2,833,930.68

利率敏感度缺口	7,134,220.26	-	-	126,978,943.96	134,113,164.22

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变。		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-22,429.38	-4,351.91
	市场利率下降 25 个基点	22,458.54	4,358.98

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	908,179,776.96	94.67	128,172,104.02	95.57
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	908,179,776.96	94.67	128,172,104.02	95.57

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	该其他价格风险的敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有股票资产的其他价格风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	假定市场基准变动5%，其他变量不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场基准上升5%	25,201,669.57	6,213,687.55
	市场基准下降5%	-25,201,669.57	-6,213,687.55

注：股票市场基准取沪深300指数。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币905,280,216.93元，属于第二层次的余额为人民币52,953,075.65元，属于第三层次的余额为人民币 2,517,394.68 元(上年度末：属于第一层次的余额为人民币125,907,678.47 元，属于第二层次的余额为人民币 7,337,575.71 元，属于第三层次的余额为人民币2,213,673.44元)。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月25日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	908,179,776.96	94.10
	其中：股票	908,179,776.96	94.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,570,910.30	5.45
	其中：债券	52,570,910.30	5.45
	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	1,197,667.77	0.12
8	其他各项资产	3,220,184.33	0.33
9	合计	965,168,539.36	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	76,888,835.60	8.02
C	制造业	579,451,071.59	60.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,956,704.00	0.93

E	建筑业	26,225,253.00	2.73
F	批发和零售业	25,788,327.00	2.69
G	交通运输、仓储和邮政业	49,650,369.00	5.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	67,367,119.00	7.02
K	房地产业	21,639,428.00	2.26
L	租赁和商务服务业	10,410,420.00	1.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,819,949.32	0.92
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	25,923,602.00	2.70
S	综合	-	-
	合计	901,121,078.51	93.94

8.2.2 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	6,309,819.44	0.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	148,491.58	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	350,772.97	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	162,846.86	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,932.31	0.00
S	综合	-	-
	合计	7,058,698.45	0.74

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	002408	齐翔腾达	2,232,400	23,440,200.00	2.44
2	600867	通化东宝	2,078,600	22,781,456.00	2.37
3	000932	华菱钢铁	3,170,000	16,198,700.00	1.69
4	002128	电投能源	1,046,800	15,544,980.00	1.62
5	600373	中文传媒	1,235,100	15,265,836.00	1.59
6	002430	杭氧股份	498,900	14,971,989.00	1.56
7	002572	索菲亚	641,900	14,250,180.00	1.49
8	002080	中材科技	383,592	13,049,799.84	1.36
9	603228	景旺电子	377,600	13,038,528.00	1.36
10	600486	扬农化工	95,500	12,529,600.00	1.31
11	601000	唐山港	4,549,700	12,511,675.00	1.30
12	600188	兖矿能源	522,000	12,282,660.00	1.28
13	000723	美锦能源	741,100	12,028,053.00	1.25
14	000733	振华科技	91,300	11,346,764.00	1.18
15	600329	中新药业	352,200	11,062,602.00	1.15
16	002138	顺络电子	286,200	10,927,116.00	1.14
17	600529	山东药玻	244,400	10,729,160.00	1.12
18	601928	凤凰传媒	1,317,400	10,657,766.00	1.11
19	600563	法拉电子	45,600	10,597,440.00	1.10
20	300763	锦浪科技	45,600	10,558,680.00	1.10
21	600623	华谊集团	1,150,100	10,465,910.00	1.09
22	600901	江苏租赁	2,051,400	10,441,626.00	1.09
23	002010	传化智联	1,196,600	10,410,420.00	1.09
24	000960	锡业股份	527,700	10,305,981.00	1.07
25	002557	洽洽食品	163,600	10,038,496.00	1.05
26	002191	劲嘉股份	650,500	9,842,065.00	1.03
27	600039	四川路桥	807,300	9,719,892.00	1.01
28	603198	迎驾贡酒	139,600	9,695,220.00	1.01
29	600546	山煤国际	1,159,500	9,519,495.00	0.99
30	601717	郑煤机	816,800	9,466,712.00	0.99
31	000975	银泰黄金	1,070,320	9,397,409.60	0.98
32	300285	国瓷材料	218,300	9,293,031.00	0.97
33	002508	老板电器	256,600	9,242,732.00	0.96
34	300463	迈克生物	314,700	9,186,093.00	0.96
35	600170	上海建工	2,550,600	9,182,160.00	0.96
36	600511	国药股份	289,600	9,131,088.00	0.95
37	600216	浙江医药	525,900	8,982,372.00	0.94

38	000598	兴蓉环境	1,417,200	8,956,704.00	0.93
39	603568	伟明环保	241,444	8,819,949.32	0.92
40	000983	山西焦煤	1,056,800	8,739,736.00	0.91
41	601866	中远海发	2,677,900	8,703,175.00	0.91
42	002002	鸿达兴业	1,436,000	8,702,160.00	0.91
43	002384	东山精密	317,400	8,601,540.00	0.90
44	601577	长沙银行	1,099,700	8,588,657.00	0.90
45	000636	风华高科	286,500	8,537,700.00	0.89
46	603605	珀莱雅	40,500	8,436,555.00	0.88
47	300037	新宙邦	74,100	8,373,300.00	0.87
48	600409	三友化工	961,600	8,365,920.00	0.87
49	603866	桃李面包	293,000	8,321,200.00	0.87
50	600256	广汇能源	1,270,000	8,305,800.00	0.87
51	002056	横店东磁	439,100	8,285,817.00	0.86
52	601699	潞安环能	731,000	8,267,610.00	0.86
53	002532	天山铝业	1,012,400	8,251,060.00	0.86
54	600299	安迪苏	653,600	8,052,352.00	0.84
55	601598	中国外运	1,796,400	8,047,872.00	0.84
56	603456	九洲药业	142,905	8,039,835.30	0.84
57	601128	常熟银行	1,195,000	7,898,950.00	0.82
58	000959	首钢股份	1,372,000	7,861,560.00	0.82
59	300699	光威复材	91,900	7,763,712.00	0.81
60	002152	广电运通	648,700	7,719,530.00	0.80
61	000778	新兴铸管	1,770,000	7,664,100.00	0.80
62	600908	无锡银行	1,332,700	7,556,409.00	0.79
63	002244	滨江集团	1,621,400	7,555,724.00	0.79
64	603650	彤程新材	149,100	7,502,712.00	0.78
65	600348	华阳股份	631,000	7,477,350.00	0.78
66	603589	口子窖	105,500	7,476,785.00	0.78
67	300630	普利制药	135,700	7,468,928.00	0.78
68	600325	华发股份	1,238,700	7,456,974.00	0.78
69	600062	华润双鹤	553,300	7,397,621.00	0.77
70	300363	博腾股份	82,000	7,334,900.00	0.76
71	600970	中材国际	640,700	7,323,201.00	0.76
72	603267	鸿远电子	40,400	7,249,376.00	0.76
73	002078	太阳纸业	629,100	7,228,359.00	0.75
74	002223	鱼跃医疗	190,200	7,189,560.00	0.75
75	600704	物产中大	1,205,700	7,137,744.00	0.74
76	002233	塔牌集团	671,500	7,104,470.00	0.74
77	002690	美亚光电	189,200	7,087,432.00	0.74
78	002867	周大生	394,850	7,020,433.00	0.73
79	000988	华工科技	250,700	6,984,502.00	0.73
80	300357	我武生物	121,800	6,979,140.00	0.73

81	601880	辽港股份	4,017,400	6,950,102.00	0.72
82	601187	厦门银行	1,002,600	6,917,940.00	0.72
83	601958	金钼股份	1,003,400	6,873,290.00	0.72
84	600885	宏发股份	92,000	6,866,880.00	0.72
85	002925	盈趣科技	201,000	6,840,030.00	0.71
86	600801	华新水泥	353,800	6,828,340.00	0.71
87	001872	招商港口	398,900	6,761,355.00	0.70
88	002563	森马服饰	865,400	6,689,542.00	0.70
89	600377	宁沪高速	774,500	6,676,190.00	0.70
90	002958	青农商行	1,727,600	6,668,536.00	0.70
91	600064	南京高科	709,500	6,626,730.00	0.69
92	000686	东北证券	744,800	6,539,344.00	0.68
93	002966	苏州银行	963,000	6,519,510.00	0.68
94	300223	北京君正	48,500	6,499,000.00	0.68
95	002185	华天科技	503,000	6,393,130.00	0.67
96	002948	青岛银行	1,346,900	6,236,147.00	0.65
97	688029	南微医学	29,235	6,217,407.45	0.65
98	600580	卧龙电驱	336,700	6,158,243.00	0.64
99	600549	厦门钨业	262,000	5,929,060.00	0.62

8.3.2 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	688516	奥特维	6,000	1,474,320.00	0.15
2	300751	迈为股份	1,700	1,091,910.00	0.11
3	603816	顾家家居	10,000	771,600.00	0.08
4	688772	珠海冠宇	12,960	506,606.40	0.05
5	603799	华友钴业	3,000	330,930.00	0.03
6	688211	中科微至	4,351	310,313.32	0.03
7	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.03
8	688766	普冉股份	704	241,281.92	0.03
9	688151	华强科技	6,119	221,997.32	0.02
10	688285	高铁电气	15,159	138,553.26	0.01
11	301182	凯旺科技	2,932	103,061.60	0.01
12	688210	统联精密	2,218	87,677.54	0.01
13	688718	唯赛勃	3,145	87,147.95	0.01
14	688799	华纳药厂	1,917	78,079.41	0.01
15	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
16	301155	海力风电	749	72,465.75	0.01
17	301177	迪阿股份	515	59,781.20	0.01
18	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
19	301087	可孚医疗	672	50,628.48	0.01

20	688517	金冠电气	2,892	39,446.88	0.00
21	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
22	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
23	300973	立高食品	213	28,133.04	0.00
24	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
25	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
26	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
27	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
28	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
29	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
30	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
31	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
32	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
33	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
34	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
35	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
36	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
37	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
38	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
39	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
40	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
41	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
42	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
43	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
44	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
45	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
46	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
47	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
48	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
49	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
50	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
51	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
52	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
53	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
54	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
55	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
56	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
57	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
58	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
59	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
60	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
61	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
62	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00

63	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
64	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
65	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
66	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
67	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
68	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
69	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
70	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
71	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
72	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
73	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
74	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
75	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
76	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
77	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
78	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
79	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
80	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
81	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
82	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
83	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
84	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
85	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
86	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
87	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
88	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
89	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
90	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
91	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
92	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
93	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
94	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
95	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
96	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
97	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
98	871245	威博液压	200	1,936.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600803	新奥股份	27,717,754.84	20.67
2	000932	华菱钢铁	25,226,643.89	18.81
3	600801	华新水泥	25,183,863.61	18.78
4	600867	通化东宝	22,823,256.77	17.02
5	002408	齐翔腾达	21,562,320.66	16.08
6	002056	横店东磁	20,479,363.11	15.27
7	002128	电投能源	17,946,031.00	13.38
8	002028	思源电气	17,766,084.56	13.25
9	600188	兖矿能源	16,636,522.60	12.40
10	002572	索菲亚	16,036,292.22	11.96
11	600373	中文传媒	15,974,324.92	11.91
12	600985	淮北矿业	15,489,019.18	11.55
13	600039	四川路桥	15,276,500.00	11.39
14	002430	杭氧股份	14,810,471.00	11.04
15	000877	天山股份	14,797,838.90	11.03
16	601636	旗滨集团	14,615,043.54	10.90
17	601233	桐昆股份	14,492,577.00	10.81
18	601000	唐山港	14,280,302.00	10.65
19	002080	中材科技	14,039,672.08	10.47
20	000960	锡业股份	13,504,424.60	10.07
21	300285	国瓷材料	12,571,563.60	9.37
22	600089	特变电工	12,509,469.19	9.33
23	603568	伟明环保	12,217,377.44	9.11
24	002233	塔牌集团	11,994,272.48	8.94
25	600563	法拉电子	11,989,769.69	8.94
26	300463	迈克生物	11,912,085.00	8.88
27	000528	柳工	11,882,428.00	8.86
28	601117	中国化学	11,879,602.68	8.86
29	600170	上海建工	11,793,315.81	8.79
30	600486	扬农化工	11,644,199.72	8.68
31	300763	锦浪科技	11,589,642.00	8.64
32	000723	美锦能源	11,560,671.26	8.62
33	000975	银泰黄金	11,427,119.87	8.52
34	002532	天山铝业	11,209,288.00	8.36
35	000598	兴蓉环境	11,156,124.00	8.32
36	603198	迎驾贡酒	11,101,364.57	8.28
37	603866	桃李面包	11,013,447.24	8.21
38	600511	国药股份	10,894,280.78	8.12
39	600546	山煤国际	10,790,020.96	8.05
40	600998	九州通	10,753,385.06	8.02
41	600623	华谊集团	10,734,030.00	8.00
42	000983	山西焦煤	10,721,923.68	7.99

43	600901	江苏租赁	10,707,063.33	7.98
44	601598	中国外运	10,572,527.82	7.88
45	000733	振华科技	10,529,502.00	7.85
46	601928	凤凰传媒	10,377,940.00	7.74
47	300316	晶盛机电	10,341,886.00	7.71
48	601717	郑煤机	10,243,484.35	7.64
49	603228	景旺电子	10,234,055.88	7.63
50	002138	顺络电子	10,146,615.39	7.57
51	600141	兴发集团	10,086,723.17	7.52
52	002010	传化智联	10,010,494.93	7.46
53	600062	华润双鹤	9,815,961.77	7.32
54	600739	辽宁成大	9,795,086.00	7.30
55	300207	欣旺达	9,748,573.44	7.27
56	002690	美亚光电	9,714,625.00	7.24
57	603515	欧普照明	9,711,793.00	7.24
58	601866	中远海发	9,702,643.00	7.23
59	300630	普利制药	9,660,378.03	7.20
60	600329	中新药业	9,580,678.07	7.14
61	000959	首钢股份	9,552,499.00	7.12
62	600529	山东药玻	9,478,968.64	7.07
63	600582	天地科技	9,465,057.00	7.06
64	600216	浙江医药	9,332,049.29	6.96
65	600256	广汇能源	9,238,012.00	6.89
66	600642	申能股份	9,221,795.68	6.88
67	600956	新天绿能	9,186,462.00	6.85
68	603650	彤程新材	9,114,511.14	6.80
69	002221	东华能源	9,097,101.00	6.78
70	000999	华润三九	9,052,943.32	6.75
71	603858	步长制药	9,046,031.54	6.75
72	002648	卫星化学	9,011,603.42	6.72
73	600409	三友化工	8,964,799.00	6.68
74	600064	南京高科	8,946,482.85	6.67
75	300037	新宙邦	8,919,161.02	6.65
76	002508	老板电器	8,869,302.00	6.61
77	601577	长沙银行	8,679,462.00	6.47
78	002002	鸿达兴业	8,620,227.00	6.43
79	000883	湖北能源	8,565,657.00	6.39
80	002281	光迅科技	8,543,655.00	6.37
81	603456	九洲药业	8,513,563.07	6.35
82	000636	风华高科	8,459,330.16	6.31
83	601128	常熟银行	8,392,915.00	6.26
84	601699	潞安环能	8,328,318.78	6.21
85	002925	盈趣科技	8,231,568.20	6.14

86	000027	深圳能源	8,206,223.93	6.12
87	000799	酒鬼酒	8,198,265.40	6.11
88	603605	珀莱雅	8,190,621.00	6.11
89	601880	辽港股份	8,145,193.50	6.07
90	002081	金螳螂	8,031,015.77	5.99
91	002191	劲嘉股份	8,010,300.00	5.97
92	600006	东风汽车	8,005,407.67	5.97
93	002444	巨星科技	7,958,849.35	5.93
94	002384	东山精密	7,916,663.00	5.90
95	300363	博腾股份	7,910,184.00	5.90
96	600299	安迪苏	7,888,323.00	5.88
97	603267	鸿远电子	7,874,130.00	5.87
98	000988	华工科技	7,835,639.07	5.84
99	600580	卧龙电驱	7,718,066.82	5.75
100	300699	光威复材	7,710,196.11	5.75
101	002867	周大生	7,641,809.00	5.70
102	002048	宁波华翔	7,592,606.96	5.66
103	600390	五矿资本	7,564,099.80	5.64
104	600908	无锡银行	7,554,304.00	5.63
105	000028	国药一致	7,546,372.98	5.63
106	002557	洽洽食品	7,540,287.25	5.62
107	601005	重庆钢铁	7,524,327.00	5.61
108	600466	蓝光发展	7,522,200.00	5.61
109	600643	爱建集团	7,508,090.22	5.60
110	000778	新兴铸管	7,493,260.00	5.59
111	601611	中国核建	7,474,951.00	5.57
112	600970	中材国际	7,459,562.50	5.56
113	002429	兆驰股份	7,430,211.37	5.54
114	600895	张江高科	7,430,056.00	5.54
115	002152	广电运通	7,391,546.00	5.51
116	601958	金钼股份	7,357,201.00	5.49
117	002078	太阳纸业	7,338,721.52	5.47
118	603589	口子窖	7,328,713.04	5.46
119	300741	华宝股份	7,127,770.25	5.31
120	000685	中山公用	7,105,804.00	5.30
121	688029	南微医学	7,081,190.96	5.28
122	300357	我武生物	7,076,314.00	5.28
123	300223	北京君正	7,055,651.00	5.26
124	001872	招商港口	7,050,048.40	5.26
125	002653	海思科	7,047,116.54	5.25
126	600663	陆家嘴	7,044,331.92	5.25
127	600348	华阳股份	7,033,450.48	5.24
128	600325	华发股份	7,028,615.11	5.24

129	603638	艾迪精密	7,020,147.91	5.23
130	601187	厦门银行	7,017,141.32	5.23
131	000581	威孚高科	7,007,066.19	5.22
132	002302	西部建设	6,983,692.56	5.21
133	300274	阳光电源	6,903,089.00	5.15
134	601997	贵阳银行	6,881,685.60	5.13
135	600917	重庆燃气	6,875,461.23	5.13
136	000686	东北证券	6,840,229.00	5.10
137	603444	吉比特	6,831,947.00	5.09
138	600704	物产中大	6,816,321.00	5.08
139	002244	滨江集团	6,808,335.00	5.08
140	600528	中铁工业	6,788,531.85	5.06
141	600885	宏发股份	6,759,986.00	5.04
142	002185	华天科技	6,753,138.00	5.04
143	002958	青农商行	6,702,792.00	5.00
144	600820	隧道股份	6,651,790.00	4.96
145	600377	宁沪高速	6,632,080.00	4.95
146	002223	鱼跃医疗	6,590,592.00	4.91
147	002948	青岛银行	6,517,238.00	4.86
148	002966	苏州银行	6,514,235.00	4.86
149	600549	厦门钨业	6,502,195.30	4.85
150	603517	绝味食品	6,451,707.92	4.81
151	002563	森马服饰	6,418,052.00	4.79
152	002603	以岭药业	6,310,903.88	4.71
153	002901	大博医疗	6,307,155.63	4.70
154	002372	伟星新材	6,228,630.33	4.64
155	601966	玲珑轮胎	6,141,021.59	4.58
156	603345	安井食品	5,931,560.57	4.42
157	002507	涪陵榨菜	5,778,086.00	4.31
158	002511	中顺洁柔	5,470,688.00	4.08
159	600282	南钢股份	4,518,717.00	3.37
160	603816	顾家家居	4,272,474.13	3.19
161	002568	百润股份	4,029,127.34	3.00
162	300496	中科创达	3,622,487.00	2.70
163	300595	欧普康视	3,544,779.00	2.64
164	000009	中国宝安	3,398,963.40	2.53
165	601799	星宇股份	3,328,400.00	2.48
166	002385	大北农	3,249,816.00	2.42
167	000739	普洛药业	2,943,179.26	2.19
168	002266	浙富控股	2,892,440.00	2.16
169	603806	福斯特	2,846,325.20	2.12
170	601200	上海环境	2,823,144.44	2.11
171	300257	开山股份	2,759,904.08	2.06

172	600388	龙净环保	2,727,114.90	2.03

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002028	思源电气	30,249,598.09	22.56
2	600803	新奥股份	29,857,260.65	22.26
3	002056	横店东磁	21,416,888.00	15.97
4	600039	四川路桥	19,923,829.00	14.86
5	600089	特变电工	19,016,447.77	14.18
6	601117	中国化学	16,783,511.00	12.51
7	600801	华新水泥	16,512,223.83	12.31
8	300207	欣旺达	16,311,169.00	12.16
9	600141	兴发集团	15,784,865.00	11.77
10	000877	天山股份	14,520,619.42	10.83
11	300316	晶盛机电	14,276,169.88	10.64
12	600985	淮北矿业	13,751,950.72	10.25
13	601636	旗滨集团	13,694,804.00	10.21
14	601233	桐昆股份	12,884,371.00	9.61
15	002648	卫星化学	12,354,929.17	9.21
16	600956	新天绿能	12,058,394.77	8.99
17	000528	柳工	11,881,213.90	8.86
18	600563	法拉电子	11,275,705.74	8.41
19	000999	华润三九	10,887,198.84	8.12
20	603568	伟明环保	10,689,834.33	7.97
21	002048	宁波华翔	10,651,496.63	7.94
22	601611	中国核建	10,485,001.00	7.82
23	000027	深圳能源	10,453,875.80	7.79
24	600582	天地科技	9,924,065.80	7.40
25	600739	辽宁成大	9,705,114.00	7.24
26	600642	申能股份	9,615,346.96	7.17
27	002221	东华能源	9,538,569.20	7.11
28	300274	阳光电源	9,336,774.16	6.96
29	600998	九州通	9,240,100.58	6.89
30	002444	巨星科技	9,041,233.00	6.74
31	300741	华宝股份	9,015,952.04	6.72
32	002372	伟星新材	8,955,205.44	6.68
33	002281	光迅科技	8,884,759.11	6.62
34	000883	湖北能源	8,872,370.93	6.62
35	000685	中山公用	8,712,911.00	6.50
36	603858	步长制药	8,649,136.78	6.45

37	603515	欧普照明	8,620,561.50	6.43
38	000799	酒鬼酒	8,513,536.14	6.35
39	603345	安井食品	8,033,760.48	5.99
40	002080	中材科技	7,915,486.11	5.90
41	601966	玲珑轮胎	7,829,133.20	5.84
42	600188	兖矿能源	7,806,058.00	5.82
43	600820	隧道股份	7,573,613.00	5.65
44	002653	海思科	7,542,158.98	5.62
45	603444	吉比特	7,521,192.00	5.61
46	000581	威孚高科	7,444,622.37	5.55
47	000028	国药一致	7,379,617.69	5.50
48	600528	中铁工业	7,256,996.48	5.41
49	600006	东风汽车	7,197,558.74	5.37
50	002302	西部建设	7,088,258.00	5.29
51	600643	爱建集团	7,046,170.00	5.25
52	603198	迎驾贡酒	7,019,290.00	5.23
53	600580	卧龙电驱	6,970,491.00	5.20
54	002603	以岭药业	6,676,927.20	4.98
55	603517	绝味食品	6,675,169.00	4.98
56	300595	欧普康视	6,668,894.03	4.97
57	002507	涪陵榨菜	6,625,155.00	4.94
58	002081	金螳螂	6,616,958.00	4.93
59	000932	华菱钢铁	6,546,272.00	4.88
60	600390	五矿资本	6,517,540.00	4.86
61	002429	兆驰股份	6,506,231.00	4.85
62	002233	塔牌集团	6,282,615.00	4.68
63	601997	贵阳银行	6,109,874.40	4.56
64	600895	张江高科	6,078,839.00	4.53
65	600917	重庆燃气	6,053,213.00	4.51
66	600663	陆家嘴	5,781,568.98	4.31
67	002568	百润股份	5,761,963.00	4.30
68	601005	重庆钢铁	5,755,764.00	4.29
69	600282	南钢股份	5,754,390.00	4.29
70	000009	中国宝安	5,754,175.18	4.29
71	000960	锡业股份	5,648,974.07	4.21
72	300496	中科创达	5,606,721.00	4.18
73	603638	艾迪精密	5,459,802.90	4.07
74	002128	电投能源	5,449,153.70	4.06
75	600256	广汇能源	5,386,103.00	4.02
76	600466	蓝光发展	5,273,444.00	3.93
77	002511	中顺洁柔	5,204,347.56	3.88
78	603816	顾家家居	5,169,673.74	3.85
79	601799	星宇股份	5,095,936.00	3.80

80	002901	大博医疗	4,675,290.00	3.49
81	600170	上海建工	4,599,399.00	3.43
82	300285	国瓷材料	4,521,478.00	3.37
83	600062	华润双鹤	4,434,313.45	3.31
84	603806	福斯特	4,396,664.60	3.28
85	002385	大北农	4,392,077.00	3.27
86	600171	上海贝岭	4,300,340.07	3.21
87	601200	上海环境	4,049,011.50	3.02
88	000739	普洛药业	4,019,951.90	3.00
89	600905	三峡能源	3,929,959.13	2.93
90	300630	普利制药	3,929,761.66	2.93
91	000513	丽珠集团	3,858,847.00	2.88
92	002266	浙富控股	3,801,788.70	2.83
93	600373	中文传媒	3,768,481.00	2.81
94	600388	龙净环保	3,755,165.00	2.80
95	601000	唐山港	3,750,790.00	2.80
96	300257	开山股份	3,743,692.32	2.79
97	601139	深圳燃气	3,641,435.00	2.72
98	000598	兴蓉环境	3,545,906.96	2.64
99	600008	首创环保	3,534,612.00	2.64
100	600064	南京高科	3,420,602.40	2.55
101	600575	淮河能源	3,410,685.00	2.54
102	000975	银泰黄金	3,267,022.00	2.44
103	002191	劲嘉股份	3,266,857.00	2.44
104	600026	中远海能	3,236,840.00	2.41
105	603866	桃李面包	3,052,482.26	2.28
106	000600	建投能源	3,042,232.18	2.27
107	600511	国药股份	2,938,261.00	2.19
108	603883	老百姓	2,924,560.80	2.18
109	002019	亿帆医药	2,899,031.00	2.16
110	601598	中国外运	2,789,005.00	2.08
111	600073	上海梅林	2,787,116.00	2.08

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,656,473,585.14
卖出股票收入（成交）总额	985,685,577.76

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	52,533,910.30	5.48
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）	37,000.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,570,910.30	5.48

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019649	21国债01	284,600	28,465,692.00	2.97
2	019654	21国债06	240,610	24,068,218.30	2.51
3	113634	珀莱转债	370	37,000.00	0.00
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	166,217.24
2	应收证券清算款	772,118.02
3	应收股利	-
4	应收利息	1,049,529.80
5	应收申购款	1,232,319.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,220,184.33

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688772	珠海冠宇	506,606.40	0.05	新股锁定期流通受限

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
鹏扬中证 500 质量成长 A	13,872	24,234.49	228,679,551.32	68.02%	107,501,325.40	31.98%
鹏扬中证 500 质量成长 C	89,161	1,973.73	42,284,886.82	24.03%	133,694,858.37	75.97%
合计	103,033	4,970.84	270,964,438.14	52.91%	241,196,183.77	47.09%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏扬中证 500 质量成长 A	1,299,765.37	0.3866%
	鹏扬中证 500 质量成长 C	357,372.00	0.2031%
	合计	1,657,137.37	0.3236%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏扬中证 500 质量成长 A	0~10
	鹏扬中证 500 质量成长 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏扬中证 500 质量成长 A	0
	鹏扬中证 500 质量成长 C	0
	合计	0

注：截至本报告期末，本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

§10 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
基金合同生效日（2019年8月29日）基金份额总额	161,066,763.89	141,968,715.83
本报告期期初基金份额总额	74,958,997.60	15,313,096.85
本报告期基金总申购份额	442,900,343.31	525,629,858.87
减：本报告期基金总赎回份额	181,678,464.19	364,963,210.53
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	336,180,876.72	175,979,745.19

注：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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

本基金管理人于2021年7月10日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》，李刚先生自2021年7月9日起不再担任鹏扬基金管理有限公司副总经理。本基金管理人已按有关规定报中国基金业协会和北京证监局备案。

2、基金托管人托管部门：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币75,000.00元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	958,299,204.07	36.61%	691,591.46	36.60%	-
兴业证券	2	751,556,399.64	28.71%	542,684.35	28.72%	-
海通证券	2	469,281,458.27	17.93%	338,561.81	17.92%	-
中信建投	3	438,283,013.66	16.74%	316,616.33	16.76%	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-

注：(1)基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务。

(2)基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

(3)在上述租用的券商交易单元中，野村东方国际证券的交易单元，中信建投的部分交易单元为本基金本报告期内新增的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	6,020,521.60	7.75%	166,100,000.00	13.35%	-	-
兴业证券	40,251,193.70	51.82%	697,500,000.00	56.05%	-	-

海通证券	15,887,310.80	20.45%	178,000,000.00	14.30%	-	-
中信建投	15,510,828.40	19.97%	202,900,000.00	16.30%	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在上海浦东发展银行股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 1 月 4 日
2	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 1 月 22 日
3	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 1 月 28 日
4	鹏扬基金管理有限公司关于旗下鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金指数信息查询途径的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 1 月 30 日
5	鹏扬基金管理有限公司关于旗下开放式基金在珠海盈米基金销售有限公司开展转换费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 1 日
6	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 29 日
7	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金 2020 年年度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 30 日
8	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金合同	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 31 日
9	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金托管协议	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 31 日
10	鹏扬基金管理有限公司关于修订鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金合同等法律文件的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 3 月 31 日
11	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(鹏扬中证 500 质量成长 A 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 2 日
12	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金更新的招募说明书(2021 年第 1 号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 2 日
13	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(鹏扬中证 500 质量成长 C 份额)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 2 日

	基金产品资料概要(更新)		
14	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 6 日
15	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在天风证券股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 20 日
16	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 4 月 22 日
17	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 5 月 17 日
18	鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 5 月 25 日
19	鹏扬基金管理有限公司关于旗下鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金在招商银行股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 5 月 25 日
20	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 6 月 3 日
21	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 6 月 17 日
22	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 6 月 29 日
23	鹏扬基金管理有限公司关于新增基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 8 日
24	鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 10 日
25	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在北京蛋卷基金销售有限公司开展转换费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 13 日
26	鹏扬基金管理有限公司关于新增基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 16 日
27	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 21 日
28	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 28 日

29	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金在招商证券股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 30 日
30	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(鹏扬中证 500 质量成长 C 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 30 日
31	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金更新的招募说明书(2021 年第 2 号)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 30 日
32	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金(鹏扬中证 500 质量成长 A 份额)基金产品资料概要(更新)	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 7 月 30 日
33	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 8 月 3 日
34	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 8 月 26 日
35	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在招商银行旗下招赢通平台开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 8 月 26 日
36	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金 2021 年中期报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 8 月 31 日
37	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在腾安基金销售有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 8 月 31 日
38	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国建设银行股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 9 月 7 日
39	鹏扬基金管理有限公司关于旗下开放式基金在上海华夏财富开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 9 月 10 日
40	鹏扬基金管理有限公司关于暂停中国国际金融股份有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 9 月 10 日
41	鹏扬基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 9 月 10 日
42	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 9 月 23 日
43	鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 9 月 27 日
44	鹏扬基金管理有限公司关于终止上海	证监会指定报刊及网	2021 年 10 月 11 日

	尚善基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	站、公司官网	
45	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 10 月 19 日
46	鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 10 月 27 日
47	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 11 月 16 日
48	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 11 月 19 日
49	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在国信证券股份有限公司开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 11 月 25 日
50	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 11 月 25 日
51	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 12 月 7 日
52	鹏扬基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 12 月 10 日
53	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 12 月 10 日
54	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2021 年 12 月 17 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2021 年 1 月 1 日-2021 年 2 月 8 日	18,759,229.34	-	-	18,759,229.34	3.66%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

2022 年 3 月 29 日