

鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数
证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏扬基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。本中期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 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46

7.3	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	47
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6	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	54
7.7	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	54
7.8	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	54
7.9	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	54
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12	投资组合报告附注	54
§ 8	基金份额持有人信息	55
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2	期末上市基金前十名持有人	56
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.4	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	56
§ 9	开放式基金份额变动	56
§ 10	重大事件揭示	57
10.1	基金份额持有人大会决议	57
10.2	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	57
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4	基金投资策略的改变	57
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8	其他重大事件	59
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1	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	59
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录	60
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	鹏扬中证 500 质量成长 ETF
场内简称	500 质量(扩位证券简称: 500 质量成长 ETF)
基金主代码	560500
交易代码	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	902,339,000.00 份
基金合同存续期	不定期
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

2.2 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。

2.3 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	龚小武
	联系电话	010-68105888	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@pyamc.com	gongxiaowu@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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	北京市西城区复兴门外大街 A2 号西城金茂中心 16 层	上海市浦东新区银城路 167 号 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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.pyamc.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-50,463,824.05
本期利润	-20,558,612.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0212
本期加权平均净值利润率	-2.34%
本期基金份额净值增长率	-2.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-120,196,887.30
期末可供分配基金份额利润	-0.1332
期末基金资产净值	782,142,112.70
期末基金份额净值	0.8668
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-13.32%

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

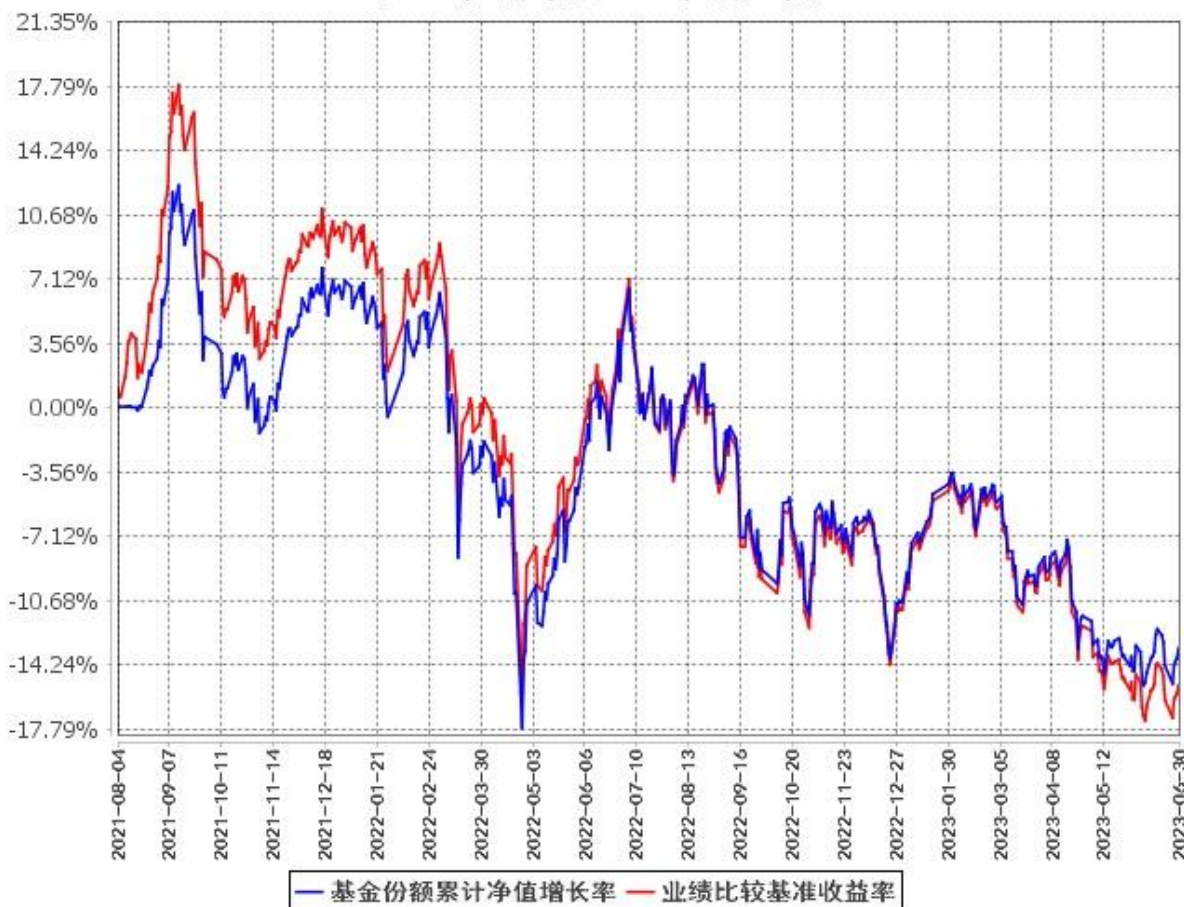
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

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
过去一个月	1.48%	0.87%	0.96%	0.90%	0.52%	-0.03%
过去三个月	-5.04%	0.86%	-6.88%	0.88%	1.84%	-0.02%
过去六个月	-2.83%	0.81%	-4.70%	0.83%	1.87%	-0.02%
过去一年	-16.40%	1.03%	-18.74%	1.05%	2.34%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-13.32%	1.20%	-15.37%	1.23%	2.05%	-0.03%

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

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
(2021年8月4日至2023年6月30日)



§ 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,总部位于北京。

公司坚持特色化经营,逐渐形成主动股票、特色指数、多资产 FOF 和传统强项固收业务齐头并进的多元化格局。

公司践行高质量发展。在公司治理和人才战略方面,公司充分发挥专业人士控股的治理结构优势,汇聚海内外优秀人才,致力于打造一支将服务投资者作为长期事业的人才队伍。公司核心投资人员均具有 10 年以上知名金融机构工作经历。公司持续开展“鲲鹏人才培养计划”,为应届毕业生提供就业岗位,充实投研与金融科技人才梯队。

公司致力于打造平台化、团队化、一体化的投研体系,实现“宏观、策略、行业、公司”的全维度研究覆盖,为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。其中,固收团队持续提升宏观研究与资产配置、利率交易、信用研究、转债增强等核心投资能力,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,遵循基本面理念严选个股,同时充分保留基金经理自身风格特点;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。

公司高度注重风险管理,并以科技赋能业务。公司从文化上树立全员风险防范意识;从制度上实现风险管理对投前、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”正式上线运行,实现研究、投资、交易、风控的一体化,大幅提升资管全流程的运作效率,提升风险管理的有效性。

凭借优异的投资业绩和出色的风险管理能力,公司旗下产品鹏扬利泽于 2023 年在证券时报社主办的第十八届中国基金业明星基金奖中荣获“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。银河证券《公募基金管理人长期主动股票投资管理能力和榜单》显示,截至 2023 年 6 月 30 日,鹏扬基金近三年的股票投资主动管理收益率为 23.29%,在 125 家参评公募基金管理人中排名第 12。

公募基金行业高质量发展需要创新驱动。鹏扬基金长期关注客户所需,坚持守正创新。在中国公募基金行业成立 25 周年之际,公司旗下的鹏扬利泽和鹏扬数字经济 ETF 凭借创新性和优秀的持续表现,分别作为国内首只中短债基金和首只数字经济 ETF,入选《中国基金报》五年一度的“行业

创新范例”（固收类、指数类）。2023 年 6 月，鹏扬基金发行的国内首只 30 年期国债 ETF 正式上市，不仅为投资者配置超长期国债，管理久期风险提供了全新的工具，而且提升了国债二级市场流动性，助力国债市场高质量发展。

鹏扬基金作为一家有理想、有担当的公募基金公司，全面履行社会责任，持续开展投资者教育和公益慈善活动。作为中国基金业协会投教专委会委员单位，公司积极联合各类媒体平台和行业机构力量，开展投资者教育工作。在中国基金业协会的指导下，公司深入三四线城市和校园，开展多层次的投教活动，内容涵盖基金投资基础知识和进阶经济金融专业讲座。2023 年 3 月，包括公司总经理在内的 6 位投研负责人开启了为期一年的线上实盘定投，并定期提供投教与陪伴，与投资者共赴长期投资、价值投资之约。在我国国债期货合约上市 10 周年以及 30 年国债期货上市之年，公司在中国基金业协会、中国金融期货交易所的指导下，举行多场面向专业投资者的投教活动，助力行业稳步推进金融衍生品投资，提升资本市场长期稳定性。在 2023 年“7.1”前夕，公司在延安市延长县初级中学捐助的“金鹏电教室”落地，为乡村振兴和教育事业贡献力量。

鹏扬基金以“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。公司的长远目标是成为中国资本市场上有影响力的、能持续为客户创造价值的资产管理公司。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，寻求服务投资者的最佳方案，在大资管行业迈向高阶发展的进程中行稳致远。

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	2021 年 8 月 4 日	-	18	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

				<p>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；2023 年 4 月 25 日至今任鹏扬北证 50 成份指数证券投资基金基金经理；2023 年 5 月 19 日至今任鹏扬中债-30 年期国债交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 6 月 29 日至今任鹏扬国证财富管理交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</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。

4.2 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 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公司旗下管理的所有投资组合，在本报告期内不同时间窗口下(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。

4.3.2 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，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现涉及本基金的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的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

2023年上半年，全球经济动能呈现超预期的韧性。1季度，在前期金融条件走松的背景下，美国1、2月非农就业数据大超预期，制造业PMI见底回升，服务业PMI以及消费数据持续较强；进入3月，美国与欧洲陆续出现银行风波，可能到来的信贷条件紧缩效应使得美联储加息必要性显著下降。2季度，随着4、5月份经济数据持续超预期，前期硅谷银行风波引发的信贷条件收紧的担忧得到缓释。与此同时，美国核心通胀下行仍然缓慢，劳动力市场依旧紧俏，市场重新修正美国政策利率预期。

2023 年上半年，中国经济动能脉冲式修复后回落。1 季度，随着疫情防控政策放松以及房地产政策松绑，生产、消费与投资活动全面回暖。进入 2 季度，国内总量政策主动收缩，产业政策保持积极，经济动能有所放缓，消费、投资均回归正常节奏。而外需压力重新显现，出口增速出现明显回落。随着逆周期政策加码以及经济自调节因子回升，经济环比动能企稳。通货膨胀方面，由于中国地产投资承压、美国商品消费回落、海外供应链压力缓解，上半年 PPI 同比持续下滑。在国内劳动力供给充足、能源供给回升、房价低迷的背景下，上半年核心 CPI 下滑压力加大。流动性方面，2 月份资金面受贷款投放强劲、超储率较低等因素影响波动较大。但是进入 3 月，人民银行意外下调存款准备金率 25bp，降准叠加 MLF 超量续作呵护资金面预期。4 月资金面较为均衡，利率中枢在政策利率附近。进入 5 月后，信贷投放以及经济内生动能偏弱，资金面较为充裕，利率中枢回落到政策利率以下。6 月中旬人民银行提前下调政策利率，MLF 持续超量续作。信用扩张方面，1 季度社融超预期走强，企业端整体融资需求强劲，企业债券融资受前期冲击后出现企稳回升的迹象。居民端短期融资需求回暖，中长期信贷仍偏弱，政府端财政依然靠前发力。2 季度，社融同比增速转弱，有去年同期基数效应的原因，也有 1 季度超量投放之后，信贷投放节奏强调稳定和可持续的原因。当前资金活化程度仍较低，随着经济进一步回暖以及库存去化，后续大概率会出现改善。

2023 年上半年，国内股市主要受到疫后供需脉冲后回落、政策靠前发力后放缓以及海外银行业危机冲击的影响。1-2 月，受到经济供需脉冲上行、政策靠前发力的影响，国内股市大幅反弹。进入 3 月，国内消费、投资、通胀数据低于市场预期，权益市场在 3 月上半月明显向下调整。3 月中旬，美国中小银行出现流动性危机，美联储迅速向其本土银行业以及欧洲市场提供紧急流动性，同时美债市场定价联储大幅降息，带来短期内全球流动环境的大幅改善，中间出现的瑞信被收购事件也未改变流动充裕的环境，国内权益市场持续上涨到 4 月中旬。4-5 月份，经济在前期政策靠前发力结束之后，进入内生动能观察期，制造 PMI 连续回落表明经济内生动能持续走弱，权益市场震荡回调。进入 6 月，随着稳增长政策陆续出台，以及前期库存持续去化，供需两端均出现企稳迹象，权益市场止跌震荡。从风格来看，2023 年上半年代表大盘价值风格的上证 50 指数下跌 5.43%，代表大盘成长风格的创业板指数下跌 5.61%，代表小盘风格的中证 1000 指数上涨 5.10%。其他主要宽基指数里，沪深 300 下跌 0.75%，中证 500 上涨 2.29%，受累于顺周期板块的调整，500 质量指数下跌 4.70%。从行业来看，2023 年上半年表现较好的主要是：通信、传媒、计算机等受益于数字经济与人工智能技术突破的板块，机械设备、家用电器等受益于出口超预期的板块，以及受益于上游成本下降的公用事业板块。

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的 PCF 管理、深市股票代理买卖、现金替代补券工作，同时适当参与一级市场打新以增厚组合收益，最大化

持有人利益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8668 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.83%；同期业绩比较基准收益率为-4.70%。年化跟踪误差 1.07%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

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 2023 年下半年，海外经济一方面面临一些中期压力，主要是货币财政条件持续性紧缩正在逐步发挥作用，以及前期大幅宽松产生的居民部门盈余也在逐步消耗。另一方面其下行的进度较慢，低于市场预期，主要是硅谷银行危机等问题，美联储一段时间内重新扩表，使得金融条件阶段性恢复；以及逆全球化使得西方国家需求大于供给，劳动力供给偏低等原因。综合来看西方经济形势可能继续表现出一定的“韧性”，向着“软着陆”的方向发展。上半年美国 CPI 在经济企稳的背景下出现快速回落，全球风险资产迎来一段甜蜜期。然而，当 CPI 回落到 4%后，继续下探到 2%的难度则较大，尤其是核心通胀将持续表现出很强的“粘性”，通胀的压力将导致海外央行紧缩预期再次抬升，当前市场已经不再预期下半年美联储转向降息。

展望 2023 年下半年，国内经济虽然仍存在很多周期性的问题和结构性的挑战，但也具备很多有利因素，随着政策的精准发力，我们认为下半年经济增长环比增速将逐步改善，全年预计能达成 5% 以上的增长目标。一方面，由于名义产出不足，居民、企业、地方政府三个部门都存在收入压力，在没有外力介入的前提下缺乏需求扩张潜力。另一方面，我们也看到很多有利的因素正在出现，并逐步发挥效用。首先，国内资产价格并未出现明显的泡沫，房地产市场过去 10 年的累计涨幅明显低于日本在泡沫期间的涨幅，而股票市场在过去两年已经下跌了 30%，目前风险溢价较高，估值相对合理，因此不太可能出现部分市场参与者担心的资产价格暴跌，进而引发资产负债表衰退的风险。其次，人民币有效汇率相较 2022 年初的高点下行了 10%，这对出口将形成约 5%的支撑，海外需求高于预期也使得今年的外需总体并不差。同时，我们应看到，中国在全球的出口份额已经占到了非常高的比例，在相当长的时间内，中国在全球产业链的地位难以被替代。东南亚等国家的发展在取代低端制造业的同时，也形成了新的中高端工业品、消费品需求，对中国出口并非完全是坏事，也是潜在需求方的来源。综合来看，中国未来的出口形势总体还是不错的。房地产市场上，我们注意到，地产销售在大幅下行之后，长期看有望维持在 11 亿平方米左右的面积上，而当前新开工已经下降到 9 亿平方米以下，从供给需求匹配的角度看，逻辑上未来新开工应逐步恢复到 10 亿-11 亿平方米左右，当前的新开工水平大概率已经见底。有利因素还包括居民部门消费在疫后恢复的潜力，当前消费对 GDP 的拉动只有 3%，这相对于中国强大的内需潜力而言是一个较低的比例，未来有较大的提升

空间。最后，从货币信贷端来看，当前融资环境已经显著宽松，各部门融资利率在持续下降，当前信贷供给充沛，如果后续能够逐步解决存量房贷利率和中小企业融资利率的结构性问题，将会逐步改变融资需求疲弱的问题。

综合来看，我们认为，虽然中国经济在短期内面临一定周期性的压力，但长期有利因素依然存在。随着国内经济政策的逐步发力，如果后续能够精准解决当前的几个关键性问题：居民存量房贷利率倒挂、民营企业信心不足、短期需求主体不足，那么我们有理由对下半年的经济走势更加乐观一些。

当前通胀压力较小，我们尚未看到 2023 年下半年有明显的通胀压力。核心原因是能源保供以及经济处于复苏早期，出行与消费恢复只有在中期后才会给服务通胀带来潜在上涨压力。尤其是居民部门收入尚未完全恢复，消费意愿较为疲弱，核心 CPI 依然维持在较低的位置，近 3 个月环比折年率只在 0% 附近，未来一段时间核心 CPI 大概率也会偏弱运行。预计到今年年底，中国 CPI 同比将小幅恢复到 1% 左右。PPI 方面，受到汇率贬值、海外需求好于预期等因素影响，大宗商品价格已经开始上涨，2023 年 6 月 PPI 同比数大概率已经见底。全年看，今年的 GDP 平减指数可能落在 0% 附近。

具体到金融市场上，当前市场对政策的预期总体偏低，利率曲线水平总体合理，权益风险溢价已经到偏高位置。信贷条件已经显著宽松，融资利率持续下行，居民、企业部门的融资增速有所恢复，但政府部门融资的力度显著弱于去年同期，使得信贷脉冲依然偏弱。后续发展则取决于政策能否实现如下几个核心调整：降低实际利率，对居民部门降低房贷利率尤其是存量房贷利率，对企业部门降低中小企业融资成本；中央债务置换地方债务或直接增加中央政府支出，恢复政府部门扩张，增加新的需求，直到价格回升，各部门走出负向循环；重建信心，进一步推动支持民营经济、支持消费的有力政策落地，减缓企业部门和居民部门的收缩行为。

展望 2023 年下半年权益市场，由于当前市场预期悲观，风险溢价明显偏高，股票相对债券的价值凸显，流动性水平充裕，随着稳增长政策逐步推出，叠加中美关系可能阶段性缓和，我们对后市总体持谨慎乐观的态度，预计可能以风险偏好恢复推动的阶段性反弹为主，但走向全面大牛市仍需等待经济基本面的超预期改善和企业盈利增长的快速恢复。此外，我们认为全球地缘政治风险、逆全球化背景下的去中国供应链冲击、中国人口结构问题和地方政府高债务杠杆等中长期结构性问题也会对资本市场形成长期压制。从市场风格特征来看，随着宏观政策开始转为关注民营企业信心和经济增长，上市企业盈利见到拐点，整个市场抱团科技股和高股息的通缩交易有望反转，我们认为行业的机会将较上半年更为多元。大的机会包括受益于经济复苏、PPI 同比见底的顺周期链条；受益于外需持续的出口相关板块；以及受益于人民币企稳、资金重新流入的白马股等。

4.6 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、风险管理部、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。

4.7 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。

4.8 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 托管人对本中期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本中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,680,298.09	1,649,590.47
结算备付金		418,597.05	3,304,029.21
存出保证金		84,325.46	212,513.29
交易性金融资产	6.4.7.2	776,485,500.47	935,342,437.58
其中：股票投资		776,485,500.47	935,342,437.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-1,047.45	-1,423.01
应收清算款		3,689,038.36	5,119,951.19
应收股利		139,779.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	20,919.38	-
资产总计		783,517,410.36	945,627,098.73
负债和净资产			
		本期末	上年度末
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		64,833.09	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		288,028.53	355,055.29
应付托管费		32,003.16	39,450.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,436.03	122.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	987,996.85	1,228,836.85
负债合计		1,375,297.66	1,623,465.55
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	902,339,000.00	1,058,339,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-120,196,887.30	-114,335,366.82
净资产合计		782,142,112.70	944,003,633.18
负债和净资产总计		783,517,410.36	945,627,098.73

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8668 元，基金份额总额 902,339,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-18,225,353.92	-5,189,184.28
1. 利息收入		123,640.62	9,892.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,798.07	6,370.52
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		19,937.22	3,521.84
证券出借利息收入		87,905.33	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-48,152,895.35	-9,211,541.30
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-64,203,756.87	-11,426,846.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	251,967.99	33,280.13
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	15,798,893.53	2,182,025.30
以摊余成本计量的金融		-	-

资产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	29,905,211.09	3,945,732.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-101,310.28	66,732.20
减：二、营业总支出		2,333,259.04	485,774.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,965,444.77	316,516.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	218,382.75	35,168.52
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		389.00	2.99
8. 其他费用	6.4.7.19	149,042.52	134,086.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,558,612.96	-5,674,958.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,558,612.96	-5,674,958.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-20,558,612.96	-5,674,958.73

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,058,339,000.00	-	-114,335,366.82	944,003,633.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,058,339,000.00	-	-114,335,366.82	944,003,633.18

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-156,000,000.00	-	-5,861,520.48	-161,861,520.48
（一）、综合收益总额	-	-	-20,558,612.96	-20,558,612.96
（二）、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）	-156,000,000.00	-	14,697,092.48	-141,302,907.52
其中：1. 基金申购款	30,000,000.00	-	-3,041,573.73	26,958,426.27
2. 基金赎回款	-186,000,000.00	-	17,738,666.21	-168,261,333.79
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	902,339,000.00	-	-120,196,887.30	782,142,112.70
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	159,339,000.00	-	11,174,306.79	170,513,306.79
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	159,339,000.00	-	11,174,306.79	170,513,306.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-43,000,000.00	-	-6,875,663.18	-49,875,663.18
（一）、综合收益总额	-	-	-5,674,958.73	-5,674,958.73

(二)、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)	-43,000,000.00	-	-1,200,704.45	-44,200,704.45
其中: 1. 基金申购款	17,000,000.00	-	-500,816.86	16,499,183.14
2. 基金赎回款	-60,000,000.00	-	-699,887.59	-60,699,887.59
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	116,339,000.00	-	4,298,643.61	120,637,643.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1145 号《关于准予鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由鹏扬基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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合同》(以下简称“本基金基金合同”)于 2021 年 7 月 19 日至 2021 年 7 月 30 日向社会公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次募集的有效净认购金额为人民币 424,339,000.00 元,有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 93,488.36 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0712 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,本基金基金合同于 2021 年 8 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 424,339,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定[2021]362号审核同意,本基金424,339,000.00份基金份额于2021年9月1日在上交所挂牌交易。

本基金的基金管理人鹏扬基金管理有限公司以本基金为目标ETF,募集成立了鹏扬中证500质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“鹏扬中证500质量成长ETF联接基金”)。鹏扬中证500质量成长ETF联接基金为交易型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金还可少量投资于非成份股(含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。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,可以相应调整本基金的投资范围的规定。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;其他金融工具的投资比例依据法律法规和监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资比例的规定。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,680,298.09
等于：本金	2,680,028.56
加：应计利息	269.53
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	2,680,298.09

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	797,969,208.27	-	776,485,500.47	-21,483,707.80
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	797,969,208.27	-	776,485,500.47	-21,483,707.80

注：股票投资的公允价值和公允价值变动均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-1,047.45	-
银行间市场	-	-
合计	-1,047.45	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	20,919.38
待摊费用	-
合计	20,919.38

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	672,083.62
其中：交易所市场	672,083.62
银行间市场	-
应付利息	-
应付替代款	67,145.71
预提费用	248,767.52
合计	987,996.85

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,058,339,000.00	1,058,339,000.00
本期申购	30,000,000.00	30,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-186,000,000.00	-186,000,000.00
本期末	902,339,000.00	902,339,000.00

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	39,769,928.68	-154,105,295.50	-114,335,366.82
本期利润	-50,463,824.05	29,905,211.09	-20,558,612.96
本期基金份额交易产生的变动数	-5,594,453.89	20,291,546.37	14,697,092.48
其中：基金申购款	1,048,889.25	-4,090,462.98	-3,041,573.73
基金赎回款	-6,643,343.14	24,382,009.35	17,738,666.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,288,349.26	-103,908,538.04	-120,196,887.30

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	4,974.31	
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	8,967.62	
其他	1,856.14	
合计	15,798.07	

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-60,274,923.47	
股票投资收益——赎回差价收入	-3,928,833.40	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	-64,203,756.87	

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	549,974,907.91	
减：卖出股票成本总额	608,898,018.12	
减：交易费用	1,351,813.26	

买卖股票差价收入	-60,274,923.47
----------	----------------

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	168,261,333.79
减：现金支付赎回款总额	90,171,329.79
减：赎回股票成本总额	82,018,837.40
减：交易费用	-
赎回差价收入	-3,928,833.40

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	194.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	251,773.50
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	251,967.99

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,616,038.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,364,000.00
减：应计利息总额	200.35
减：交易费用	64.60
买卖债券差价收入	251,773.50

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	15,798,893.53
其中：证券出借权益补偿收入	251,569.20
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,798,893.53

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	29,905,211.09
——股票投资	29,905,211.09
——债券投资	-
——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	29,905,211.09

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-101,310.28

合计	-101,310.28
----	-------------

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	275.00
IOPV 计算与发布费用	49,588.57
合计	149,042.52

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
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 ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,965,444.77	316,516.81
其中：支付销售机构的客户维护费	11,865.35	24,157.78

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：

$$H = E \times 0.45\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	218,382.75	35,168.52

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 0.05% 年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接	802,246,100.00	88.91%	946,246,100.00	89.41%

注：以上关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

6.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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	2,680,298.09	4,974.31	907,211.15	2,905.13

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有托管人或其他关联方发行证券。于上年度可比期末 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有托管人或其他关联方发行证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
688343	云天励飞	2023年3月28日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	43.92	50.67	14,561	639,519.12	737,805.87	
688486	龙迅股份	2023年2月10日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	
688472	阿特斯	2023年6月2日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	11.10	17.04	3,033	33,666.30	51,682.32	
688361	中科飞测	2023年5月12日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	23.60	64.67	774	18,266.40	50,054.58	
301358	湖南裕能	2023年2月1日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	23.77	42.89	1,149	27,311.73	49,280.61	
001286	陕西能源	2023年3月31日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	
688484	南芯科技	2023年3月28日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	39.99	36.71	911	36,430.89	33,442.81	
688146	中船特气	2023年4月13日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	36.15	38.13	863	31,197.45	32,906.19	
301291	明阳电气	2023年6月21日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	38.13	31.03	1,040	39,655.20	32,271.20	
301246	宏源药业	2023年3月10日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	
688352	颀中科技	2023年4月11日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	
301486	致尚科技	2023年6月30日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	
301310	鑫宏业	2023年5月26日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	
688582	芯动联科	2023年6月21日	上市后6个月	新股锁定期流	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	

				通受限						
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	11.88	21.02	1,105	13,127.40	23,227.10	
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	6.58	7.58	2,706	17,805.48	20,511.48	
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50	
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	
301439	泓淋电	2023 年 3 月	上市后 6 个月	新股锁	19.99	16.90	949	18,970.	16,038.	

	力	10 日	月	定期流 通受限				51	10	
688623	双元科 技	2023 年 5 月 31 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	125.88	86.79	178	22,406. 64	15,448. 62	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	14.81	13.73	1,122	16,616. 82	15,405. 06	-
301408	华人健 康	2023 年 2 月 22 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	16.24	16.95	879	14,274. 96	14,899. 05	-
301305	朗坤环 境	2023 年 5 月 15 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	25.25	19.69	753	19,013. 25	14,826. 57	-
301397	溯联股 份	2023 年 6 月 15 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	53.27	40.20	362	19,283. 74	14,552. 40	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	24.80	43.85	330	8,184.0 0	14,470. 50	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	14.16	16.21	888	12,574. 08	14,394. 48	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	11.18	14.59	959	10,721. 62	13,991. 81	-
301387	光大同 创	2023 年 4 月 10 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	58.32	45.36	307	17,904. 24	13,925. 52	-
301322	绿通科 技	2023 年 2 月 27 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	131.11	53.24	261	34,219. 71	13,895. 64	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	23.80	32.84	408	9,710.4 0	13,398. 72	-
301320	豪江智 能	2023 年 6 月 1 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	13.06	20.62	642	8,384.5 2	13,238. 04	-
688433	华曙高 科	2023 年 4 月 7 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	26.66	31.50	418	11,143. 88	13,167. 00	-
688629	华丰科 技	2023 年 6 月 16 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	9.26	18.59	708	6,556.0 8	13,161. 72	-

688620	安凯微	2023年6月15日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301292	海科新源	2023年6月29日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301315	威士顿	2023年6月13日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023年5月4日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023年6月2日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	上市后6个月	新股锁定期流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023年3月21日	上市后6个月	新股锁定期流	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

				通受限						
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	
301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	上市后 6 个月	新股锁定期流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	
301281	科源制	2023 年 3 月	上市后 6 个月	新股锁	44.18	25.10	241	10,647.	6,049.1	

	药	28 日	月	定期流 通受限				38	0	
001380	华纬科 技	2023 年 5 月 9 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	28.84	30.78	170	4,902.8 0	5,232.6 0	
603125	常青科 技	2023 年 3 月 30 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	25.98	24.53	160	4,156.8 0	3,924.8 0	
001328	登康口 腔	2023 年 3 月 29 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	20.68	25.49	145	2,998.6 0	3,696.0 5	
001282	三联锻 造	2023 年 5 月 15 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	27.93	33.03	105	2,932.6 5	3,468.1 5	
001360	南矿集 团	2023 年 3 月 31 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	15.38	14.87	177	2,722.2 6	2,631.9 9	
603137	恒尚节 能	2023 年 4 月 10 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	15.90	17.09	139	2,210.1 0	2,375.5 1	
001324	长青科 技	2023 年 5 月 12 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	18.88	19.60	114	2,152.3 2	2,234.4 0	
001367	海森药 业	2023 年 3 月 30 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	44.48	39.48	55	2,446.4 0	2,171.4 0	
603172	万丰股 份	2023 年 4 月 28 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	14.58	16.13	122	1,778.7 6	1,967.8 6	
301301	川宁生 物	2022 年 12 月 20 日	上市后 6 个 月	新股锁 定期流 通受限	5.00	8.96	3,574	17,870. 00	32,023. 04	
301486	致尚科 技	2023 年 6 月 30 日	5 个交易日	新股未 上市流 通受限	57.66	57.66	4,338	250,129 .08	250,129 .08	
301292	海科新 源	2023 年 6 月 29 日	6 个交易日	新股未 上市流 通受限	19.99	19.99	5,241	104,767 .59	104,767 .59	
301202	朗威股 份	2023 年 6 月 28 日	5 个交易日	新股未 上市流 通受限	25.82	25.82	2,754	71,108. 28	71,108. 28	
688603	天承科 技	2023 年 6 月 30 日	6 个交易日	新股未 上市流 通受限	55.00	55.00	1,251	68,805. 00	68,805. 00	

301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	7 个交易日	新股未上市流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688507	索辰科技	-	上市后 6 个月	锁定期送/转股	-	122.11	72	-	8,791.92	-
301322	绿通科技	-	上市后 6 个月	锁定期送/转股	-	53.24	130	-	6,921.20	-
301281	科源制药	-	上市后 6 个月	锁定期送/转股	-	25.10	96	-	2,409.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌流通受限	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	312,300	1,830,310.41	2,176,731.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
1	002738	中矿资源	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	50.94	48,100	2,450,214.00
2	002966	苏州银行	2023 年 7 月 4 日	6.55	371,900	2,435,945.00
3	688390	固德威	2023 年 7 月 11 日	166.86	12,400	2,069,064.00
4	000933	神火股份	2023 年 7 月 4 日	13.00	148,700	1,933,100.00
5	603444	吉比特	2023 年 7 月 13 日	491.11	3,700	1,817,107.00
6	300832	新产业	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 14 日	59.00	30,600	1,805,400.00
7	603596	伯特利	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 12 日	79.26	22,600	1,791,276.00
8	688516	奥特维	2023 年 7 月 5 日	188.40	9,400	1,770,960.00

9	300017	网宿科技	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 12 日	7.11	243,200	1,729,152.00
10	300595	欧普康视	2023 年 7 月 13 日	30.19	54,000	1,630,260.00
11	300438	鹏辉能源	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	48.04	28,800	1,383,552.00
12	002531	天顺风能	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	15.23	87,100	1,326,533.00
13	600873	梅花生物	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	8.93	145,500	1,299,315.00
14	000739	普洛药业	2023 年 7 月 4 日	17.74	69,100	1,225,834.00
15	002244	滨江集团	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 11 日	8.82	138,700	1,223,334.00
16	600348	华阳股份	2023 年 7 月 4 日	7.91	151,300	1,196,783.00
17	688188	柏楚电子	2023 年 7 月 3 日	188.56	6,300	1,187,928.00
18	002444	巨星科技	2023 年 7 月 12 日	21.88	53,400	1,168,392.00
19	600598	北大荒	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 12 日	13.33	81,200	1,082,396.00
20	603456	九洲药业	2023 年 7 月 10 日	27.38	39,100	1,070,558.00
21	600582	天地科技	2023 年 7 月 3 日	5.83	178,700	1,041,821.00
22	603816	顾家家居	2023 年 7 月 11 日	38.15	25,200	961,380.00
23	600546	山煤国际	2023 年 7 月 11 日	14.47	66,000	955,020.00
24	603233	大参林	2023 年 7 月 14 日	28.01	34,000	952,340.00
25	601958	金钼股份	2023 年 7 月 11 日	11.15	82,800	923,220.00
26	603529	爱玛科技	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 12 日	32.22	28,400	915,048.00
27	603228	景旺电子	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	25.65	35,200	902,880.00
28	603568	伟明环保	2023 年 7 月 5 日	17.51	51,000	893,010.00
29	000155	川能动力	2023 年 7 月 14 日	14.40	61,900	891,360.00
30	300888	稳健医疗	2023 年 7 月 3 日	41.67	20,400	850,068.00
31	688029	南微医学	2023 年 7 月 3 日	81.56	10,200	831,912.00
32	002867	周大生	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	17.78	46,600	828,548.00
33	000937	冀中能源	2023 年 7 月 4 日	6.38	123,700	789,206.00
34	688006	杭可科技	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	30.47	22,200	676,434.00
35	000563	陕国投 A	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 11 日	3.05	197,300	601,765.00
36	600415	小商品城	2023 年 7 月 13 日	8.53	65,000	554,450.00
37	000591	太阳能	2023 年 7 月 11 日	6.78	70,000	474,600.00
38	002507	涪陵榨菜	2023 年 7 月 5 日	18.31	25,600	468,736.00
39	300866	安克创新	2023 年 7 月 14 日	87.50	3,700	323,750.00
40	002600	领益智造	2023 年 7 月 3 日	6.91	40,000	276,400.00

41	603317	天味食品	2023 年 7 月 11 日	14.61	18,300	267,363.00
42	603688	石英股份	2023 年 7 月 3 日	113.84	2,200	250,448.00
43	603056	德邦股份	2023 年 7 月 3 日	15.42	15,600	240,552.00
44	002463	沪电股份	2023 年 7 月 14 日	20.94	11,400	238,716.00
45	300009	安科生物	2023 年 7 月 10 日	10.00	10,000	100,000.00
46	002032	苏泊尔	2023 年 7 月 10 日	50.00	1,000	50,000.00
47	600863	内蒙华电	2023 年 7 月 4 日	4.15	2,900	12,035.00
合计	-	-	-	-	2,994,400	47,868,165.00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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、风险管理人員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內。

6.4.13.2 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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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“6.4.12 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 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
-----	-------	-------	-------	-----	----

2023 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	2,680,298.09	-	-	-	2,680,298.09
结算备付金	418,597.05	-	-	-	418,597.05
存出保证金	84,325.46	-	-	-	84,325.46
交易性金融资产	-	-	-	776,485,500.47	776,485,500.47
买入返售金融资产	-1,047.45	-	-	-	-1,047.45
应收清算款	-	-	-	3,689,038.36	3,689,038.36
应收股利	-	-	-	139,779.00	139,779.00
其他资产	-	-	-	20,919.38	20,919.38
资产总计	3,182,173.15	-	-	780,335,237.21	783,517,410.36
负债					
应付清算款	-	-	-	64,833.09	64,833.09
应付管理人报酬	-	-	-	288,028.53	288,028.53
应付托管费	-	-	-	32,003.16	32,003.16
应交税费	-	-	-	2,436.03	2,436.03
其他负债	-	-	-	987,996.85	987,996.85
负债总计	-	-	-	1,375,297.66	1,375,297.66
利率敏感度缺口	3,182,173.15	-	-	778,959,939.55	782,142,112.70
上年度末 2022 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	1,649,590.47	-	-	-	1,649,590.47
结算备付金	3,304,029.21	-	-	-	3,304,029.21
存出保证金	212,513.29	-	-	-	212,513.29
交易性金融资产	-	-	-	935,342,437.58	935,342,437.58
买入返售金融资产	-1,423.01	-	-	-	-1,423.01
应收清算款	-	-	-	5,119,951.19	5,119,951.19
资产总计	5,164,709.96	-	-	940,462,388.77	945,627,098.73
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	355,055.29	355,055.29
应付托管费	-	-	-	39,450.59	39,450.59
应交税费	-	-	-	122.82	122.82
其他负债	-	-	-	1,228,836.85	1,228,836.85
负债总计	-	-	-	1,623,465.55	1,623,465.55
利率敏感度缺口	5,164,709.96	-	-	938,838,923.22	944,003,633.18

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末及上年度末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转换债券、可交换债券）或资产支持证券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金本报告期末未持有外币计价的资产和负债，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	776,485,500.47	99.28	935,342,437.58	99.08
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	776,485,500.47	99.28	935,342,437.58	99.08

6.4.13.4.3.2 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场基准上升 5%	31,443,647.80	43,245,837.56
	市场基准下降 5%	-31,443,647.80	-43,245,837.56

注：股票市场基准取沪深 300 指数。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	771,531,763.30	934,916,386.34
第二层次	2,799,391.86	-
第三层次	2,154,345.31	426,051.24
合计	776,485,500.47	935,342,437.58

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	776,485,500.47	99.10
	其中：股票	776,485,500.47	99.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-1,047.45	0.00
	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	3,098,895.14	0.40
8	其他各项资产	3,934,062.20	0.50
9	合计	783,517,410.36	100.00

注：(1) 股票投资的金额包含可退替代款估值增值。

(2) 本基金报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 47,868,165.00 元，占期末基金资产净值的比例为 6.12%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	5,411,980.00	0.69
B	采矿业	59,988,048.40	7.67
C	制造业	524,032,349.56	67.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,643,289.00	2.77
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	30,298,892.14	3.87
G	交通运输、仓储和邮政业	12,511,492.00	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,134,410.40	4.11
J	金融业	48,394,841.00	6.19
K	房地产业	8,733,970.00	1.12

L	租赁和商务服务业	11,276,660.00	1.44
M	科学研究和技术服务业	14,244,750.00	1.82
N	水利、环境和公共设施管理业	4,459,797.00	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	773,130,479.50	98.85

7.2.2 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	2,322,632.18	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	68,091.83	0.01
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	857,589.43	0.11
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	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,355,020.97	0.43

7.2.3 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。

7.3 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

7.3.1 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	002422	科伦药业	699,100	20,749,288.00	2.65
2	002384	东山精密	695,000	18,000,500.00	2.30
3	600489	中金黄金	1,455,630	15,036,657.90	1.92
4	300724	捷佳伟创	133,700	15,021,195.00	1.92
5	000423	东阿阿胶	275,600	14,730,820.00	1.88
6	300146	汤臣倍健	607,502	14,567,897.96	1.86
7	300012	华测检测	730,500	14,244,750.00	1.82
8	601058	赛轮轮胎	1,206,400	13,740,896.00	1.76
9	002223	鱼跃医疗	366,100	13,175,939.00	1.68
10	600161	天坛生物	472,200	12,820,230.00	1.64
11	603688	石英股份	109,698	12,488,020.32	1.60
12	002738	中矿资源	240,380	12,244,957.20	1.57
13	002966	苏州银行	1,857,540	12,166,887.00	1.56
14	002463	沪电股份	566,300	11,858,322.00	1.52
15	600060	海信视像	470,300	11,639,925.00	1.49
16	600415	小商品城	1,322,000	11,276,660.00	1.44
17	002600	领益智造	1,626,100	11,236,351.00	1.44
18	002568	百润股份	302,900	11,010,415.00	1.41
19	300866	安克创新	124,600	10,902,500.00	1.39
20	000975	银泰黄金	927,900	10,856,430.00	1.39
21	688390	固德威	64,003	10,679,540.58	1.37
22	600298	安琪酵母	292,000	10,573,320.00	1.35
23	603939	益丰药房	285,680	10,570,160.00	1.35
24	603444	吉比特	21,400	10,509,754.00	1.34
25	600096	云天化	604,600	10,320,522.00	1.32
26	000591	太阳能	1,477,300	10,016,094.00	1.28
27	002372	伟星新材	486,000	9,982,440.00	1.28
28	000933	神火股份	743,100	9,660,300.00	1.24
29	300017	网宿科技	1,348,400	9,587,124.00	1.23
30	603816	顾家家居	249,700	9,526,055.00	1.22
31	000783	长江证券	1,636,000	9,488,800.00	1.21
32	002056	横店东磁	502,000	9,141,420.00	1.17
33	300832	新产业	152,700	9,009,300.00	1.15
34	603596	伯特利	113,200	8,972,232.00	1.15
35	688516	奥特维	47,182	8,889,088.80	1.14
36	300487	蓝晓科技	140,200	8,751,284.00	1.12
37	000400	许继电气	374,900	8,641,445.00	1.10
38	688002	睿创微纳	188,138	8,428,582.40	1.08
39	600873	梅花生物	941,200	8,404,916.00	1.07
40	300595	欧普康视	269,900	8,148,281.00	1.04

41	002025	航天电器	127,100	8,108,980.00	1.04
42	601128	常熟银行	1,187,000	8,095,340.00	1.04
43	002444	巨星科技	369,700	8,089,036.00	1.03
44	000728	国元证券	1,234,700	8,050,244.00	1.03
45	603233	大参林	276,164	7,735,353.64	0.99
46	603338	浙江鼎力	131,100	7,342,911.00	0.94
47	600863	内蒙华电	1,728,500	7,173,275.00	0.92
48	300438	鹏辉能源	143,600	6,898,544.00	0.88
49	600329	达仁堂	153,400	6,886,126.00	0.88
50	600985	淮北矿业	596,900	6,876,288.00	0.88
51	002507	涪陵榨菜	374,900	6,864,419.00	0.88
52	600546	山煤国际	470,500	6,808,135.00	0.87
53	600486	扬农化工	77,200	6,748,824.00	0.86
54	002531	天顺风能	434,500	6,617,435.00	0.85
55	601958	金钼股份	590,200	6,580,730.00	0.84
56	002595	豪迈科技	186,500	6,551,745.00	0.84
57	000513	丽珠集团	163,200	6,350,112.00	0.81
58	000739	普洛药业	345,200	6,123,848.00	0.78
59	002244	滨江集团	693,000	6,112,260.00	0.78
60	603927	中科软	156,600	6,038,496.00	0.77
61	688188	柏楚电子	31,815	5,999,036.40	0.77
62	600348	华阳股份	755,750	5,977,982.50	0.76
63	002508	老板电器	231,720	5,860,198.80	0.75
64	002518	科士达	143,700	5,749,437.00	0.74
65	300009	安科生物	572,000	5,720,000.00	0.73
66	002429	兆驰股份	1,008,500	5,546,750.00	0.71
67	002155	湖南黄金	454,000	5,538,800.00	0.71
68	000878	云南铜业	501,200	5,538,260.00	0.71
69	300363	博腾股份	185,919	5,501,343.21	0.70
70	600598	北大荒	406,000	5,411,980.00	0.69
71	002572	索菲亚	309,200	5,386,264.00	0.69
72	600566	济川药业	185,100	5,375,304.00	0.69
73	603456	九洲药业	195,300	5,347,314.00	0.68
74	601000	唐山港	1,495,000	5,277,350.00	0.67
75	600582	天地科技	892,900	5,205,607.00	0.67
76	603883	老百姓	173,710	5,185,243.50	0.66
77	002128	电投能源	391,800	5,179,596.00	0.66
78	603529	爱玛科技	157,700	5,081,094.00	0.65
79	300529	健帆生物	202,000	4,682,360.00	0.60
80	603228	景旺电子	176,000	4,514,400.00	0.58
81	603568	伟明环保	254,700	4,459,797.00	0.57
82	000155	川能动力	309,300	4,453,920.00	0.57

83	002032	苏泊尔	87,000	4,350,000.00	0.56
84	300888	稳健医疗	102,086	4,253,923.62	0.54
85	688029	南微医学	51,463	4,197,322.28	0.54
86	002867	周大生	232,900	4,140,962.00	0.53
87	600517	国网英大	710,400	4,049,280.00	0.52
88	000937	冀中能源	617,800	3,941,564.00	0.50
89	002831	裕同科技	160,500	3,914,595.00	0.50
90	301029	怡合达	86,220	3,852,309.60	0.49
91	002423	中粮资本	442,200	3,537,600.00	0.45
92	688006	杭可科技	110,741	3,374,278.27	0.43
93	000563	陕国投 A	985,800	3,006,690.00	0.38
94	688819	天能股份	74,703	2,752,058.52	0.35
95	603056	德邦股份	175,300	2,703,126.00	0.35
96	001914	招商积余	174,200	2,621,710.00	0.34
97	600377	宁沪高速	239,500	2,354,285.00	0.30
98	601298	青岛港	312,300	2,176,731.00	0.28
99	603317	天味食品	131,200	1,916,832.00	0.25
100	603868	飞科电器	29,700	1,873,773.00	0.24

7.3.2 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	688343	云天励飞	14,561	737,805.87	0.09
2	301291	明阳电气	10,395	337,244.20	0.04
3	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.04
4	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.04
5	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.03
6	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
7	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
8	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
9	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
10	688472	阿特斯	3,033	51,682.32	0.01
11	688361	中科飞测	774	50,054.58	0.01
12	301358	湖南裕能	1,149	49,280.61	0.01
13	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
14	688484	南芯科技	911	33,442.81	0.00
15	688146	中船特气	863	32,906.19	0.00
16	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
17	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
18	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00

19	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
20	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
21	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
22	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
23	001287	中电港	1,105	23,227.10	0.00
24	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
25	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
26	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
27	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
28	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
29	601061	中信金属	2,706	20,511.48	0.00
30	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
31	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
32	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
33	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
34	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
35	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
36	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
37	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
38	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
39	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
40	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
41	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
42	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
43	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
44	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
45	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
46	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
47	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
48	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
49	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
50	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
51	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
52	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
53	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
54	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
55	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
56	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
57	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
58	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
59	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
60	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
61	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00

62	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
63	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
64	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
65	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
66	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
67	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
68	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
69	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
70	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
71	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
72	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
73	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
74	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
75	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
76	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
77	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
78	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
79	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
80	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
81	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
82	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
83	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002422	科伦药业	21,110,311.00	2.24
2	600489	中金黄金	16,458,353.60	1.74
3	000423	东阿阿胶	14,511,178.00	1.54
4	300146	汤臣倍健	14,047,040.07	1.49
5	600415	小商品城	13,121,843.00	1.39
6	601058	赛轮轮胎	12,853,658.00	1.36
7	600161	天坛生物	12,538,446.42	1.33
8	002223	鱼跃医疗	12,117,709.00	1.28
9	002463	沪电股份	11,971,695.00	1.27
10	300017	网宿科技	11,065,485.00	1.17
11	600298	安琪酵母	10,676,967.00	1.13
12	000933	神火股份	10,668,247.00	1.13
13	300866	安克创新	10,500,477.00	1.11

14	002600	领益智造	10,480,576.00	1.11
15	002568	百润股份	10,360,085.66	1.10
16	000591	太阳能	10,327,913.00	1.09
17	000783	长江证券	10,203,784.00	1.08
18	688002	睿创微纳	9,153,308.29	0.97
19	300487	蓝晓科技	8,877,283.00	0.94
20	000728	国元证券	8,561,119.30	0.91

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。

7.4.2 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	300308	中际旭创	41,310,297.66	4.38
2	002497	雅化集团	15,649,771.92	1.66
3	603605	珀莱雅	14,343,883.90	1.52
4	300390	天华新能	14,332,561.36	1.52
5	601699	潞安环能	12,551,741.00	1.33
6	002192	融捷股份	11,604,979.00	1.23
7	300699	光威复材	11,105,433.20	1.18
8	600563	法拉电子	11,014,849.00	1.17
9	600160	巨化股份	10,671,754.00	1.13
10	688063	派能科技	10,535,768.23	1.12
11	601577	长沙银行	10,421,289.00	1.10
12	603613	国联股份	10,066,682.00	1.07
13	002273	水晶光电	9,969,266.00	1.06
14	601168	西部矿业	9,773,643.84	1.04
15	002368	太极股份	9,741,224.99	1.03
16	601872	招商轮船	9,525,460.80	1.01
17	002738	中矿资源	9,448,301.60	1.00
18	300357	我武生物	9,237,046.16	0.98
19	300568	星源材质	9,198,016.06	0.97
20	601997	贵阳银行	8,946,370.00	0.95

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。

7.4.3 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	489,857,326.32
卖出股票收入(成交)总额	549,974,907.91

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未参与股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	84,325.46
2	应收清算款	3,689,038.36
3	应收股利	139,779.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	20,919.38
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,934,062.20

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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	688343	云天励飞	737,805.87	0.09	新股流通受限
2	301486	致尚科技	277,921.20	0.04	新股流通受限
3	688486	龙迅股份	198,380.31	0.03	新股流通受限
4	301291	明阳电气	32,271.20	0.00	新股流通受限
5	688582	芯动联科	26,360.64	0.00	新股流通受限

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	鹏扬中证 500 质量成长

(户)						ETF 联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,593	347,990.36	11,754,600.00	1.30%	88,338,300.00	9.79%	802,246,100.00	88.91%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中不包含“鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	4,037,000.00	0.45%
2	晏茁	3,430,900.00	0.38%
3	招商证券股份有限公司	2,848,800.00	0.32%
4	深圳市国立智能电力科技有限公司	2,000,000.00	0.22%
5	董继凤	1,771,300.00	0.20%
6	中国平安财产保险股份有限公司— 传统—普通保险产品	1,591,200.00	0.18%
7	郑元瑞	1,090,700.00	0.12%
8	马庆明	1,000,000.00	0.11%
9	秦青林	1,000,000.00	0.11%
10	李芸	911,600.00	0.10%
11	兴业银行股份有限公司—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	802,246,100.00	88.91%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 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

截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员，基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数据区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 8 月 4 日）基金份额总额	424,339,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,058,339,000.00
本报告期基金总申购份额	30,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	186,000,000.00

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	902,339,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理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。

10.6.2 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，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中信建投	3	902,766,837.95	87.98%	655,192.42	91.28%	-
华泰证券	3	88,392,467.94	8.61%	37,240.06	5.19%	-
野村东方国际证券	2	30,689,074.07	2.99%	22,313.51	3.11%	-
兴业证券	2	4,190,687.47	0.41%	3,042.16	0.42%	-
银河证券	2	14,440.69	0.00%	10.42	0.00%	-

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等。

(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，银河证券的交易单元为本基金本报告期内剔除的交易单元。

10.7.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投	1,616,038.45	100.00%	149,027,000.00	72.43%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	39,841,000.00	19.36%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	16,896,000.00	8.21%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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	鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 1 月 20 日
2	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与天天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	2023 年 2 月 8 日
3	鹏扬基金管理有限公司关于增加招商证券股份有限公司为旗下部分基金申购赎回代办券商的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 3 月 16 日
4	鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 3 月 29 日
5	鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 4 月 22 日
6	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与万得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	2023 年 4 月 25 日
7	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺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	2023 年 6 月 9 日
8	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海好买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	2023 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接	1	2023 年 1 月 1 日 -2023 年 6 月 30 日	946,246,100.00	3,000,000.00	147,000,000.00	802,246,100.00	88.91%

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。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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 8 月 30 日