

鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数  
证券投资基金  
2023 年年度报告

2023 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：2024 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 2024 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，普华永道中天会计师事务所(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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
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	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	14
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	15
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	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
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	19
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>20</b>
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>22</b>
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23

7.3 净资产变动表 .....	24
7.4 报表附注 .....	26
<b>§ 8 投资组合报告 .....</b>	<b>66</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	66
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	66
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 .....	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>76</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	76
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	77
9.4 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 .....	77
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>77</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
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 .....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	77
11.4 基金投资策略的改变 .....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
11.8 其他重大事件 .....	79
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>81</b>
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 .....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>81</b>

13.1 备查文件目录 .....	81
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	82

## § 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	873,339,000.00 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.pyamc.com">http://www.pyamc.com</a>
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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、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	2023 年	2022 年	2021 年 8 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-94,577,256.66	-4,295,382.97	18,681,405.07
本期利润	-79,782,387.98	-61,708,876.15	24,705,979.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0857	-0.2547	0.0969
本期加权平均净值利润率	-9.91%	-26.96%	9.39%
本期基金份额净值增长率	-10.25%	-16.64%	7.01%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-174,116,120.36	-114,335,366.82	11,174,306.79
期末可供分配基金份额利润	-0.1994	-0.1080	0.0701

期末基金资产净值	699,222,879.64	944,003,633.18	170,513,306.79
期末基金份额净值	0.8006	0.8920	1.0701
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-19.94%	-10.80%	7.01%

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
过去三个月	-3.61%	0.82%	-3.84%	0.83%	0.23%	-0.01%
过去六个月	-7.64%	0.80%	-8.74%	0.81%	1.10%	-0.01%
过去一年	-10.25%	0.80%	-13.03%	0.81%	2.78%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-19.94%	1.12%	-22.77%	1.15%	2.83%	-0.03%



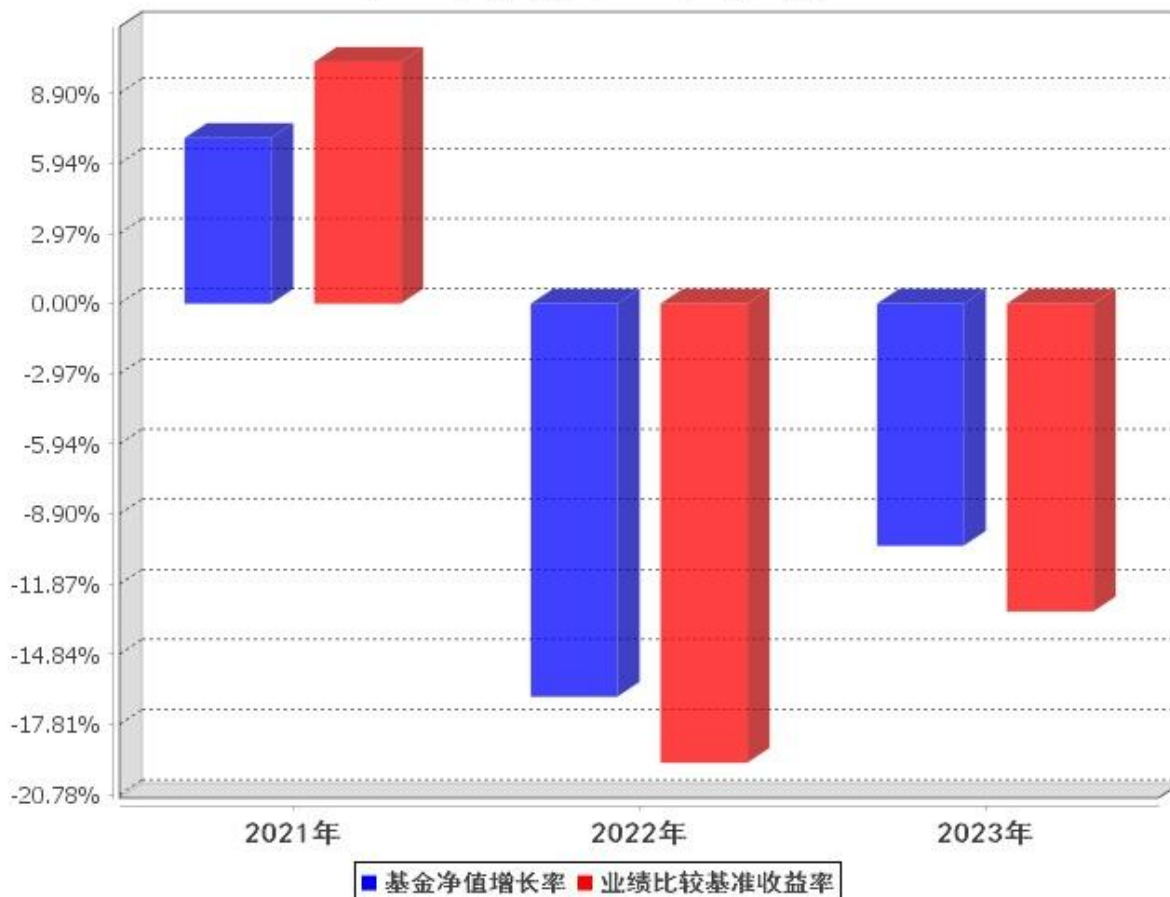
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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12月31日)



### 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

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对比图  
(2021年8月4日至2023年12月31日)



注：本基金合同于 2021 年 8 月 4 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，总部位于北京。截至 2023 年 12 月末，公司管理公募资产总规模 951 亿元，累计创造投资收益超 181 亿元，分红超 80 亿元。

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。

公司形成了固定收益、主动股票、特色指数、主动量化、多资产五大业务板块，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；指数量化团队聚焦高质量核心资产，以科学方法深挖面向未来的行业主题和选股因子，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，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。

2023 年度，鹏扬基金在上海证券报社举办的第 20 届金基金评选中，获“金基金-成长基金管理公司奖”。公司旗下产品鹏扬利泽在证券时报社主办的第 18 届中国基金业明星基金奖中获“五年持续回报积极债券型明星基金奖”。公司发扬固定收益业务优势特色，在银行间本币市场锐意进取，在全国银行间同业拆借中心开展的 2023 年银行间本币市场成员业务高质量发展评价中，获得“市场进步机构”称号。

鹏扬基金长期关注客户所需，服务实体经济，坚持创新驱动高质量发展。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限国债、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。随着金融行业转向高质量发展，财富管理业务前景发展广阔，鹏扬基金于 2023 年 6 月成功发行了财富管理 ETF，这是目前国内市场上唯一的财富管理主题 ETF，为普通投资者分享财富管理行业成长红利提供了便捷的投资工具。随着国企改革行动对国企盈利能力的改善，国企投资价值逐渐提升，鹏扬基金于 2023 年 8 月成功发行了国企红利 ETF，为广大投资者提供了“中特估”主题策略指数投资工具。

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，内容涵盖居民理财基础知识和经济金融专业讲座。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

				<p>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 2023 年 8 月 17 日任鹏扬中债 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；2023 年 8 月 17 日至今任鹏扬数字经济先锋混合型证券投资基金基金经理；2023 年 8 月 25 日至今任鹏扬中证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2023 年 12 月 19 日至今任鹏扬消费量化选股混合型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，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，美国经济展现出较强的韧性。尽管年初市场对美国经济在美联储持续货币紧缩压力下有着较强的衰退预期，但从全年看，美国经济由于宽松的财政政策支持整体沿着“软着陆”的方向演绎。期间，3 月的硅谷银行破产引发市场对信贷紧缩的担忧，但该事件并未对经济产生显著的负面影响，美国就业和消费保持较强的韧性。2023 年，美联储共加息 100BP，从 9 月份的 FOMC 会议开始暂缓加息。10 月以后伴随着通胀水平的逐步回落，美联储的态度出现明显转向，市场对于 2024 年预防式降息的预期也逐步升温，美债利率在 10 月短暂冲高到 5% 以上后逐步回落，美国纳斯达克股票指数大幅回升创出历史新高。

2023 年，中国经济在疫后修复、政策保持定力、地产延续调整等因素的影响下一波三折。2023 年年初，中国经济迎来了近几年最强的“开门红”，1 季度 GDP 环比增长 2.2%。进入 2 季度，地产销售明显走弱，地方政府卖地收入锐减，经济有所承压。7 月政治局定调之下，政策重新发力。3 季度政策效果显著，叠加居民出行旺季，经济企稳回升。进入 4 季度，房地产市场再次下滑，资金利率上行，经济动能有所走弱。通货膨胀方面，2023 年物价整体承压。全年来看，CPI 同比持续回落，

猪肉价格低迷带动了食品价格走弱，油价回落带来能源价格走弱，需求不足带来耐用品价格低迷，服务价格温和上涨，PPI 与核心 CPI 低位震荡。流动性方面，1 季度信贷投放强劲，资金面总体偏紧。2 季度经济基本面有所回落，央行引导资金利率持续下行。为降低实体经济融资成本，央行在 6 月下调了 LPR 利率，在 6 月和 8 月两次下调了 OMO、MLF 利率。8 月中旬之后，海外利率上行带来汇率承压，央行收紧资金面以维护汇率稳定，流动性持续偏紧。12 月之后，汇率压力有所缓解，叠加财政资金逐步投放，资金利率逐步回落。信用扩张方面，2023 年社融先上后下。1 季度信贷数据实现“开门红”，广义社融同比增速回升。但随后企业端融资需求已经得到充分满足，叠加房地产销售回落，企业与居民中长期贷款走弱。8 月之后，在地方政府债发行加速的背景下，社融增速逐步温和回升。总体来看，私人部门融资需求依然偏弱，需要进一步降低实体经济融资成本。

2023 年，国内股市在年初冲高后呈现震荡下行走势。1 月，市场在经济改善预期加强和流动性充裕的背景下呈现开门红。2 月，伴随着美国金融条件重新收紧，A 股转为震荡。3 月至 6 月，经济复苏呈现放缓的势头，股市整体走弱。经济复苏放缓带来政策托底预期升温，股市也在 7 月出现一定的回暖。但从 8 月中旬开始至年底，美债利率持续大幅上行，国内经济动能回落，股市整体表现持续低迷。从风格来看，代表大盘价值的上证 50 指数全年下跌了 11.73%，代表成长风格的创业板指数全年下跌了 19.41%，价值风格占优。从行业板块来看，表现较好的主要是受益于人工智能趋势的传媒、通信等板块，以及受益于高分红的煤炭、石油石化等上游资源板块和国有大型银行板块。主要宽基指数里，沪深 300 指数下跌 11.38%，中证 500 指数下跌 7.42%。中证 500 质量成长指数下跌 13.03%。

过去一年里 500 质量成长指数相对中证 500 的超额收益波动性有所增加，超额有所回撤，原因主要是受累于 ROE 因子的回撤。ROE 因子的回撤开始于 2021 年初，它的回撤与市场常探讨的核心资产回撤是重叠的，因为核心资产往往 ROE 较高。在 ROE 因子回撤的前半段，500 质量成长指数仍有超额，主要原因是所使用的成长因子“SUE”（标准化预期外盈利因子）此前仍有超额。而过去一年里，市场风格偏红利、偏小盘，ROE 因子和成长因子均有回撤。基于以上情况，我们在 500 质量成长指数后续的方案修订中考虑 ROE 因子时会兼顾估值水平，成长因子会考虑使用复合因子，同时还会增加盈余波动率的剔除，因为长期看高盈余波动率的个股会显著跑输基准。另外，如果可以用贵和便宜来形容风格的话，高 ROE 和成长这两个风格都已经调整得较为便宜了。从逻辑和历史表现看，这两个风格均有较明显超额，只是在 2019 及 2020 年牛市中，核心资产和高成长资产被买贵了，但目前它们是估值偏低的。

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，同时积极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 0.8006 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.25%；同期业绩比较基准收益率为-13.03%。年化跟踪误差 0.78%，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 2024 年，海外经济动能预计将出现一段时间的回升，但是劳动力市场热度的逐渐降温将驱使美国经济逐步走向浅衰退。我们预计 2024 年海外经济将先演绎降息预期回摆的逻辑，2024 年 2 季度之后，经济将周期性放缓，美联储转向预防性降息。全球通胀将在 2024 年延续放缓，但美国通胀相对维持韧性。若美联储选择预防性降息，二次通胀压力将有所回升。总体来看，全球主要央行货币政策转向将带来全球流动性改善和风险偏好的提升。

展望 2024 年，国内经济将在政策逐步积极的背景下波浪式前行。居民部门资产负债表受损，高债务负担、高实际利率、交付风险将抑制购房需求。我们预计 2024 年新房销售同比负增长但环比将反弹，地产施工与投资的下滑压力较大。企业部门实际投资回报率较低，叠加地缘政治不确定性，企业逆周期增加国内资本开支的意愿不强。地方政府部门的债务风险在“一揽子化债方案”出台之后得到大幅缓解，但债务存量依然庞大，且城投平台监管力度加强叠加土地收入持续低迷，地方政府总体扩表能力有限。综合上述分析，我们预计居民和企业部门、地方政府、金融部门均面临一定收缩压力，对外部门向上弹性有限，中央政府财政扩张空间较大，央行有能力引导实际利率下行，这将是经济政策加力的主要方向。

中央经济工作会议定调 2024 年是“稳中求进、以进促稳、先立后破”的一年，需要增强宏观政策取向一致性，以求形成更大的政策合力。在当前居民购房行为对需求侧政策响应偏弱以及房企信用风险依然存在的背景下，房地产的供需政策大概率将继续加码。从货币信贷端来看，实体经济融资成本将继续降低，信贷新增供给将更多用于促进科技创新、先进制造、绿色发展和中小微企业等重点领域的发展，同时积极盘活存量信贷。我们预计信贷投放将更注重质量而非数量。

在当前的宏观经济与政策环境下，通胀压力较小，我们未看到驱动通胀中枢明显上行的因素。核心原因是在劳动力供给充足、房地产市场向新发展模式转型、外需短期难以明显改善的背景下，整体物价水平难以出现明显上行，通胀中枢大概率将保持偏低位置。

展望 2024 年权益市场，考虑到股票风险溢价较高、市场情绪低迷，我们预计当市场极度超卖时，股票市场将孕育超跌反弹机会。权益市场目前面临的主要障碍是国内总量政策较为谨慎以及海外美债利率回摆和地缘政治环境带来的外部冲击风险。当前企业盈利面临一定压力，以房地产为主的内

需较乏力，出口向上无弹性，企业生产仍较积极，库存销售比处在较高水平，尤其是新兴产业面临一定的产能过剩压力。中期维度来看，随着国内货币、财政政策协同发力，私人部门预期逐步改善，企业盈利将进入上行趋势。另外，我们预计美国经济终将走向浅衰退，美债利率短期内有回摆空间，但最终将下行。我们将耐心等待企业盈利和美国经济的拐点，届时持续低迷的股票市场将面临重大转机，因此我们对权益市场会逐步转向积极乐观。

#### 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、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。

#### 4.8 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本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	普华永道中天审字(2024)第 23685 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 质量成长交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“鹏扬中证 500 质量成长 ETF 基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了鹏扬中证 500 质量成长 ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>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 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>鹏扬中证 500 质量成长 ETF 基金的基金管理人鹏扬基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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</p>

	<p>重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估鹏扬中证 500 质量成长 ETF 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，除非基金管理人管理层计划清算鹏扬中证 500 质量成长 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督鹏扬中证 500 质量成长 ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(一) 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。</p> <p>(二) 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。</p> <p>(三) 评价基金管理人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。</p> <p>(四) 对基金管理人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 ETF 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 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 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。</p> <p>我们与基金管理人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。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>周祎   耿亚男</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2024 年 3 月 27 日</p>

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	1,569,967.14	1,649,590.47
结算备付金		271,471.67	3,304,029.21
存出保证金		73,757.93	212,513.29
交易性金融资产	7.4.7.2	696,819,518.90	935,342,437.58
其中：股票投资		696,819,518.90	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-282.48	-1,423.01
应收清算款		2,278,768.62	5,119,951.19
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	46,779.65	-
资产总计		701,059,981.43	945,627,098.73
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		333,123.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		265,661.58	355,055.29
应付托管费		29,517.95	39,450.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		4,948.61	122.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,203,850.65	1,228,836.85
负债合计		1,837,101.79	1,623,465.55
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	873,339,000.00	1,058,339,000.00
未分配利润	7.4.7.8	-174,116,120.36	-114,335,366.82
净资产合计		699,222,879.64	944,003,633.18
负债和净资产总计		701,059,981.43	945,627,098.73

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8006 元，基金份额总额 873,339,000.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-75,458,654.80	-60,390,005.92
1. 利息收入		1,156,294.40	29,768.13
其中：存款利息收入	7.4.7.9	27,225.88	15,778.22
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		43,538.14	13,989.91
其他利息收入		1,085,530.38	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-91,444,447.65	-3,519,929.41
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-111,119,731.09	-6,790,396.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	325,793.92	177,018.56
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	19,349,489.52	3,093,448.04
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	14,794,868.68	-57,413,493.18

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	34,629.77	513,648.54
<b>减：二、营业总支出</b>		4,323,733.18	1,318,870.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,635,142.71	984,131.42
2. 托管费	7.4.10.2.2	403,904.73	109,347.97
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		4,065.83	40.84
8. 其他费用	7.4.7.19	280,619.91	225,350.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-79,782,387.98	-61,708,876.15
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-79,782,387.98	-61,708,876.15
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-79,782,387.98	-61,708,876.15

### 7.3 净资产变动表

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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	1,058,339,000.00	-	-114,335,366.82	944,003,633.18
二、本期期初净资产	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）	-185,000,000.00	-	-59,780,753.54	-244,780,753.54
（一）、综合收益总额	-	-	-79,782,387.98	-79,782,387.98
（二）、本期基金份额交易产生的净资	-185,000,000.00	-	20,001,634.44	-164,998,365.56



产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	86,000,000.00	-	-13,580,615.65	72,419,384.35
2. 基金赎回款	-271,000,000.00	-	33,582,250.09	-237,417,749.91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	873,339,000.00	-	-174,116,120.36	699,222,879.64
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	159,339,000.00	-	11,174,306.79	170,513,306.79
二、本期期初净资产	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）	899,000,000.00	-	-125,509,673.61	773,490,326.39
（一）、综合收益总额	-	-	-61,708,876.15	-61,708,876.15
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	899,000,000.00	-	-63,800,797.46	835,199,202.54
其中：1. 基金申购款	983,000,000.00	-	-63,133,839.38	919,866,160.62
2. 基金赎回款	-84,000,000.00	-	-666,958.08	-84,666,958.08
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,058,339,000.00	-	-114,335,366.82	944,003,633.18

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  
基金管理人负责人

崔雁巍  
主管会计工作负责人

韩欢  
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。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏扬基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 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 7.4.4 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。

#### 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资产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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以

公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金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；或者（3）该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进

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，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。采用估值技术时，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，才可以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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产权利的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 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。

以摊余成本计量的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) 本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配方案见基金管理人届时发布的相关公告；

(2) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去收益分配金额后可能低于面值；

(3) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(4) 本基金收益分配采取现金分红的方式；

(5) 每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，可对上述基金收益分配原则进行调整并提前公告。

#### 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非标的指数成份股票和债券，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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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

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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	1,569,967.14	1,649,590.47
等于：本金	1,569,759.97	1,649,319.57
加：应计利息	207.17	270.90
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	1,569,967.14	1,649,590.47

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	733,413,569.11	-	696,819,518.90	-36,594,050.21
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	733,413,569.11	-	696,819,518.90	-36,594,050.21
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	986,731,356.47	-	935,342,437.58	-51,388,918.89
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	986,731,356.47	-	935,342,437.58	-51,388,918.89

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。

### 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

#### 7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-282.48	-
银行间市场	-	-
合计	-282.48	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-1,423.01	-
银行间市场	-	-
合计	-1,423.01	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	46,779.65	-
待摊费用	-	-
合计	46,779.65	-

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	532,090.97	1,003,836.85
其中：交易所市场	532,090.97	1,003,836.85
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付替代款	391,759.68	-
预提费用	280,000.00	225,000.00
合计	1,203,850.65	1,228,836.85

#### 7.4.7.7 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 12 月 31 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	86,000,000.00	86,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-271,000,000.00	-271,000,000.00
本期末	873,339,000.00	873,339,000.00

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。

#### 7.4.7.8 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
本期期初	39,769,928.68	-154,105,295.50	-114,335,366.82
本期利润	-94,577,256.66	14,794,868.68	-79,782,387.98
本期基金份额交易产生的变动数	-4,851,698.60	24,853,333.04	20,001,634.44
其中：基金申购款	-621,427.57	-12,959,188.08	-13,580,615.65
基金赎回款	-4,230,271.03	37,812,521.12	33,582,250.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-59,659,026.58	-114,457,093.78	-174,116,120.36

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	8,770.37

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	15,922.20	8,260.08
其他	2,533.31	1,211.01
合计	27,225.88	15,778.22

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-105,105,044.47	-9,016,627.32
股票投资收益——赎回差价收入	-6,014,686.62	2,226,231.31
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	-111,119,731.09	-6,790,396.01

##### 7.4.7.10.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	954,590,792.40	779,201,217.60
减：卖出股票成本总额	1,057,516,388.88	786,004,700.24
减：交易费用	2,179,447.99	2,213,144.68
买卖股票差价收入	-105,105,044.47	-9,016,627.32

##### 7.4.7.10.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	237,417,749.91	84,666,958.08
减：现金支付赎回款总额	131,379,525.91	40,209,840.08
减：赎回股票成本总额	112,052,910.62	42,230,886.69
减：交易费用	-	-

赎回差价收入	-6,014,686.62	2,226,231.31
--------	---------------	--------------

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	221.81	274.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	325,572.11	176,744.45
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	325,793.92	177,018.56

##### 7.4.7.11.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,969,879.44	1,883,999.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,644,000.00	1,706,900.00
减：应计利息总额	228.58	279.97
减：交易费用	78.75	74.81
买卖债券差价收入	325,572.11	176,744.45

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	19,349,489.52	3,093,448.04
其中：证券出借权益补偿收入	500,753.61	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	19,349,489.52	3,093,448.04

#### 7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	14,794,868.68	-57,413,493.18
——股票投资	14,794,868.68	-57,413,493.18
——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	14,794,868.68	-57,413,493.18

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	34,629.77	513,648.54
合计	34,629.77	513,648.54



#### 7.4.7.18 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	515.00	350.00
存托服务费	104.91	-
IOPV 计算与发布费用	100,000.00	100,000.00
合计	280,619.91	225,350.00

#### 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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
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
上海济通企业管理中心（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
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。

#### 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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,635,142.71	984,131.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,525.29	36,719.65
应支付基金管理人的净管理费	3,614,617.42	947,411.77

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

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	403,904.73	109,347.97

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

##### 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

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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 12 月 31 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	765,046,100.00	87.60%	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。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	1,569,967.14	8,770.37	1,649,590.47	6,307.13

#### 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

于 2023 年 12 月 31 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 12 月 31 日，本基金未持有托管人或其他关联方发行证券。

#### 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（2023 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	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
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	9.87	12.75	2,996	29,570.52	38,199.00	-
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	78.99	60.49	555	43,839.45	33,571.95	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	38.13	28.36	1,040	39,655.20	29,494.40	-
301348	蓝箭电子	2023 年 8 月 1 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-

603296	华勤技术	2023 年 8 月 1 日	上市后六个月	新股 锁定 期流 通受 限	80.80	77.75	344	27,795.20	26,746.00	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	上市后六个月	新股 锁定 期流 通受 限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	上市后六个月	新股 锁定 期流 通受 限	42.66	48.18	498	21,244.68	23,993.64	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	上市后六个月	新股 锁定 期流 通受 限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	上市后六个月	新股 锁定 期流 通受 限	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	上市后六个月	新股 锁定 期流 通受 限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
301498	乖宝宠物	2023 年 8 月 9 日	上市后六个月	新股 锁定 期流 通受 限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301370	国科恒泰	2023 年 7 月 3 日	上市后六个月	新股 锁定 期流 通受 限	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023 年 8 月 16 日	上市后六个月	新股 锁定 期流 通受	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-

				限							
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-	
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-	
301468	博盈特焊	2023 年 7 月 12 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-	
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	99.57	81.46	215	21,407.55	17,513.90	-	
301381	赛维时代	2023 年 7 月 5 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-	
301172	君逸数码	2023 年 7 月 19 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	31.33	38.16	438	13,722.54	16,714.08	-	
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-	
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	24.22	18.24	883	21,386.26	16,105.92	-	
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	上市后六个月	新股锁定 期流	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-	

				通受限							
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	上市后六个月	新股锁定 期流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-	
301393	昊帆生物	2023 年 7 月 5 日	上市后六个月	新股锁定 期流通受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-	
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	上市后六个月	新股锁定 期流通受限	55.68	37.58	395	21,993.60	14,844.10	-	
688610	埃科光电	2023 年 7 月 10 日	上市后六个月	新股锁定 期流通受限	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-	
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	上市后六个月	新股锁定 期流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-	
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	上市后六个月	新股锁定 期流通受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-	
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	上市后六个月	新股锁定 期流通受限	11.25	11.07	1,186	13,342.50	13,129.02	-	
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	上市后六个月	新股锁定 期流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-	
301456	盘古智能	2023 年 7 月 6 日	上市后六个月	新股锁定	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-	

				期流 通受 限							
688602	康鹏 科技	2023 年 7 月 13 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-	
688719	爱科 赛博	2023 年 9 月 20 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-	
301550	斯菱 股份	2023 年 9 月 6 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	
301292	海科 新源	2023 年 6 月 29 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-	
301508	中机 认检	2023 年 11 月 23 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-	
301251	威尔 高	2023 年 8 月 30 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-	
688592	司南 导航	2023 年 8 月 7 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-	
301499	维科 精密	2023 年 7 月 13 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-	
688603	天承	2023 年	上市 后	新 股	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-	



	科技	6 月 30 日	六个月	锁定 定期流 通受限							
688653	康希 通信	2023 年 11 月 10 日	上市后 六个月	新股 锁定 定期流 通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-	
301528	多浦 乐	2023 年 8 月 17 日	上市后 六个月	新股 锁定 定期流 通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-	
301329	信音 电子	2023 年 7 月 5 日	上市后 六个月	新股 锁定 定期流 通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-	
301261	恒工 精密	2023 年 6 月 29 日	上市后 六个月	新股 锁定 定期流 通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-	
301202	朗威 股份	2023 年 6 月 28 日	上市后 六个月	新股 锁定 定期流 通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-	
688716	中研 股份	2023 年 9 月 13 日	上市后 六个月	新股 锁定 定期流 通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-	
301413	安培 龙	2023 年 12 月 11 日	上市后 六个月	新股 锁定 定期流 通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-	
301500	飞南 资源	2023 年 9 月 13 日	上市后 六个月	新股 锁定 定期流 通受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-	

301418	协昌科技	2023 年 8 月 10 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301272	英华特	2023 年 7 月 6 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301469	恒达新材	2023 年 8 月 10 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301519	舜禹股份	2023 年 7 月 19 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301518	长华化学	2023 年 7 月 26 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
688638	誉辰智能	2023 年 7 月 4 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-

				限							
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-	
688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-	
688573	信宇人	2023 年 8 月 9 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-	
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-	
688651	盛邦安全	2023 年 7 月 19 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-	
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-	
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	上市后六个月	新股锁定 期流	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-	

				通受限							
688671	碧兴物联	2023 年 8 月 2 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-	
688693	锆威特	2023 年 8 月 10 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-	
603275	众辰科技	2023 年 8 月 16 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-	
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	
603062	麦加芯彩	2023 年 10 月 31 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-	
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-	
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	上市后六个月	新股锁定 期流 通受 限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	上市后六个月	新股锁定	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-	

		日		期流 通受 限							
688648	中邮 科技	2023 年 11 月 6 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-	
001378	德冠 新材	2023 年 10 月 23 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-	
688450	光格 科技	2023 年 7 月 17 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-	
603004	鼎龙 科技	2023 年 12 月 20 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-	
603270	金帝 股份	2023 年 8 月 25 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-	
603119	浙江 荣泰	2023 年 7 月 21 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-	
603107	上海 汽配	2023 年 10 月 25 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-	
603193	润本 股份	2023 年 10 月 9 日	上市 后 六 个 月	新 股 锁 定 期 流 通 受 限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-	
001306	夏厦	2023 年	上市 后	新 股	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-	

	精密	11 月 9 日	六个月	锁定期流通受限							
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-	
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-	
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-	
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-	
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-	
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-	
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-	

#### 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

无。

### 7.4.12.4 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	期末估值总额
1	002463	沪电股份	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 11 日	22.12	120,900	2,674,308.00
2	601058	赛轮轮胎	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 8 日	11.75	222,600	2,615,550.00
3	601168	西部矿业	2024 年 1 月 10 日 -2024 年 1 月 11 日	14.27	179,600	2,562,892.00
4	002517	恺英网络	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 10 日	11.17	226,700	2,532,239.00
5	300394	天孚通信	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	91.52	24,100	2,205,632.00
6	002028	思源电气	2024 年 1 月 10 日 -2024 年 1 月 12 日	52.04	41,400	2,154,456.00
7	603596	伯特利	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	69.30	28,200	1,954,260.00
8	603939	益丰药房	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 9 日	40.04	48,600	1,945,944.00
9	688169	石头科技	2024 年 1 月 3 日	282.95	6,500	1,839,175.00
10	600096	云天化	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.60	111,700	1,742,520.00
11	002738	中矿资源	2024 年 1 月 10 日 -2024 年 1 月 12 日	37.31	46,500	1,734,915.00
12	603688	石英股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	86.88	19,400	1,685,472.00
13	688188	柏楚电子	2024 年 1 月 4 日 -2024 年 1 月 5 日	253.11	6,300	1,594,593.00
14	603816	顾家家居	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	35.00	45,500	1,592,500.00
15	300017	网宿科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	7.85	194,700	1,528,395.00
16	002472	双环传动	2024 年 1 月 9 日 -2024 年 1 月 12 日	26.02	58,300	1,516,966.00
17	002568	百润股份	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 9 日	24.61	56,900	1,400,309.00
18	002558	巨人网络	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 12 日	11.14	125,400	1,396,956.00

19	002756	永兴材料	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 12 日	52.21	26,400	1,378,344.00
20	000831	中国稀土	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	27.67	49,200	1,361,364.00
21	603338	浙江鼎力	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 8 日	51.17	26,600	1,361,122.00
22	300866	安克创新	2024 年 1 月 9 日 -2024 年 1 月 12 日	88.60	14,900	1,320,140.00
23	600839	四川长虹	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	5.29	245,600	1,299,224.00
24	600398	海澜之家	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	7.42	169,400	1,256,948.00
25	002595	豪迈科技	2024 年 1 月 4 日 -2024 年 1 月 8 日	29.77	41,700	1,241,409.00
26	600985	淮北矿业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	16.63	74,500	1,238,935.00
27	000975	银泰黄金	2024 年 1 月 4 日 -2024 年 1 月 12 日	15.00	81,600	1,224,000.00
28	300487	蓝晓科技	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 11 日	53.06	22,900	1,215,074.00
29	000400	许继电气	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 10 日	21.96	55,200	1,212,192.00
30	002372	伟星新材	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 12 日	14.47	78,900	1,141,683.00
31	601666	平煤股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	11.56	96,500	1,115,540.00
32	689009	九号公司	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	29.66	36,000	1,067,760.00
33	600873	梅花生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 5 日	9.55	111,200	1,061,960.00
34	002572	索菲亚	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 8 日	15.95	66,300	1,057,485.00
35	601717	郑煤机	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 11 日	12.65	82,200	1,039,830.00
36	688390	固德威	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	130.58	7,800	1,018,524.00
37	688516	奥特维	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	90.50	11,200	1,013,600.00
38	002223	鱼跃医疗	2024 年 1 月 2 日	34.58	28,900	999,362.00
39	601000	唐山港	2024 年 1 月 4 日 -2024 年 1 月 8 日	3.50	282,700	989,450.00
40	600298	安琪酵母	2024 年 1 月 8 日	35.18	28,100	988,558.00
41	600258	首旅酒店	2024 年 1 月 4 日	15.62	60,800	949,696.00



			-2024 年 1 月 8 日			
42	601958	金钼股份	2024 年 1 月 12 日	9.45	99,100	936,495.00
43	603927	中科软	2024 年 1 月 8 日	29.98	31,000	929,380.00
44	600566	济川药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	31.43	28,900	908,327.00
45	600535	天士力	2024 年 1 月 11 日	17.02	52,000	885,040.00
46	603568	伟明环保	2024 年 1 月 8 日	16.00	54,800	876,800.00
47	300776	帝尔激光	2024 年 1 月 10 日 -2024 年 1 月 11 日	60.26	14,500	873,770.00
48	603883	老百姓	2024 年 1 月 11 日 -2024 年 1 月 12 日	29.89	29,200	872,788.00
49	688099	晶晨股份	2024 年 1 月 1 日	62.63	13,900	870,557.00
50	002032	苏泊尔	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	53.01	16,300	864,063.00
51	002831	裕同科技	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 8 日	27.51	31,200	858,312.00
52	002508	老板电器	2024 年 1 月 8 日	21.78	39,000	849,420.00
53	300026	红日药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	4.24	185,300	785,672.00
54	002244	滨江集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	7.27	107,700	782,979.00
55	600901	江苏金租	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	4.84	159,300	771,012.00
56	000563	陕国投 A	2024 年 1 月 4 日 -2024 年 1 月 12 日	3.04	247,900	753,616.00
57	002155	湖南黄金	2024 年 1 月 8 日	11.14	63,000	701,820.00
58	002262	恩华药业	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 9 日	27.12	25,600	694,272.00
59	603606	东方电缆	2024 年 1 月 4 日 -2024 年 1 月 8 日	42.75	16,000	684,000.00
60	600598	北大荒	2024 年 1 月 8 日	11.97	51,500	616,455.00
61	603228	景旺电子	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 12 日	22.56	26,000	586,560.00
62	002600	领益智造	2024 年 1 月 4 日 -2024 年 1 月 9 日	6.76	85,100	575,276.00
63	002078	太阳纸业	2024 年 1 月 8 日	12.17	44,200	537,914.00
64	601928	凤凰传媒	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 9 日	8.81	57,100	503,051.00
65	600377	宁沪高速	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 8 日	10.25	45,400	465,350.00
66	600062	华润双鹤	2024 年 1 月 8 日	18.60	21,800	405,480.00
67	603650	彤程新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	33.30	12,000	399,600.00

68	600977	中国电影	2024 年 1 月 4 日	12.24	29,500	361,080.00
69	600486	扬农化工	2024 年 1 月 11 日	63.12	5,400	340,848.00
70	603056	德邦股份	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 12 日	14.47	22,400	324,128.00
71	002563	森马服饰	2024 年 1 月 1 日 -2024 年 1 月 12 日	5.77	56,100	323,697.00
72	603233	大参林	2024 年 1 月 10 日	24.90	12,300	306,270.00
73	601061	中信金属	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	7.71	35,900	276,789.00
74	601577	长沙银行	2024 年 1 月 8 日	6.82	39,200	267,344.00
75	600563	法拉电子	2024 年 1 月 8 日	92.60	2,800	259,280.00
76	603868	飞科电器	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	50.50	4,400	222,200.00
77	600956	新天绿能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	8.13	25,500	207,315.00
78	601139	深圳燃气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	6.89	25,400	175,006.00
79	600863	内蒙华电	2024 年 1 月 10 日 -2024 年 1 月 12 日	3.90	22,000	85,800.00
合计	-	-	-	-	5,100,600	83,367,048.00

#### 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易的合规风险、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之内。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末未持有债券。

##### 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 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,569,967.14	-	-	-	1,569,967.14
结算备付金	271,471.67	-	-	-	271,471.67
存出保证金	73,757.93	-	-	-	73,757.93
交易性金融资产	-	-	-	696,819,518.90	696,819,518.90
买入返售金融资产	-282.48	-	-	-	-282.48
应收清算款	-	-	-	2,278,768.62	2,278,768.62
其他资产	-	-	-	46,779.65	46,779.65
资产总计	1,914,914.26	-	-	699,145,067.17	701,059,981.43
负债					
应付清算款	-	-	-	333,123.00	333,123.00
应付管理人报酬	-	-	-	265,661.58	265,661.58
应付托管费	-	-	-	29,517.95	29,517.95
应交税费	-	-	-	4,948.61	4,948.61
其他负债	-	-	-	1,203,850.65	1,203,850.65
负债总计	-	-	-	1,837,101.79	1,837,101.79
利率敏感度缺口	1,914,914.26	-	-	697,307,965.38	699,222,879.64
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					
货币资金	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。

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 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 2023 年 12 月 31 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	696,819,518.90	99.66	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	696,819,518.90	99.66	935,342,437.58	99.08

##### 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场基准上升 5%	26,807,611.57	43,245,837.56
市场基准下降 5%	-26,807,611.57	-43,245,837.56	

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 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	695,615,575.17	934,916,386.34
第二层次	-	-
第三层次	1,203,943.73	426,051.24
合计	696,819,518.90	935,342,437.58

###### 7.4.14.2.2 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。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	426,051.24	426,051.24
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,888,660.57	2,888,660.57
转出第三层次	-	2,630,901.11	2,630,901.11
当期利得或损失总额	-	520,133.03	520,133.03
其中：计入损益的利得或损失	-	520,133.03	520,133.03
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,203,943.73	1,203,943.73
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	155,999.76	155,999.76
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	686,797.93	686,797.93
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	845,630.95	845,630.95
转出第三层次	-	1,042,134.45	1,042,134.45
当期利得或损失总额	-	-64,243.19	-64,243.19
其中：计入损益的利得或损失	-	-64,243.19	-64,243.19
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	426,051.24	426,051.24



期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	3,156.44	3,156.44
--	---	----------	----------

注：第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票	1,203,943.73	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%~219.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票	426,051.24	平均价格亚式期权模型	预期波动率	28.78%~104.40%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2023 年度,本基金申购基金份额的对价总额为 72,419,384.35 元(2022 年度:919,866,160.62 元),其中包括以股票支付的申购款 30,580,318.00 元和以现金支付的申购款 41,839,066.35 元(2022 年度:其中包括以股票支付的申购款 504,499,313.24 元和以现金支付的申购款 415,366,847.38 元)。

(2)除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	696,819,518.90	99.40
	其中：股票	696,819,518.90	99.40
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	-282.48	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	1,841,438.81	0.26
8	其他各项资产	2,399,306.20	0.34
9	合计	701,059,981.43	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 83,367,048.00 元，占期末基金资产净值的比例为 11.92%。

### 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	3,411,450.00	0.49
B	采矿业	74,120,774.00	10.60
C	制造业	457,623,560.56	65.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,408,397.00	2.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,385,756.70	4.20
G	交通运输、仓储和邮政业	8,874,000.00	1.27
H	住宿和餐饮业	4,706,306.00	0.67
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,431,732.51	7.07
J	金融业	32,930,590.40	4.71
K	房地产业	3,946,883.00	0.56
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	4,363,200.00	0.62
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	6,412,925.00	0.92
S	综合	-	-
	合计	695,615,575.17	99.48

### 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	1,039,110.99	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	56,342.59	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	13,129.02	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,805.85	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.82	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,203,943.73	0.17

### 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	601058	赛轮轮胎	1,346,700	15,823,725.00	2.26

2	002463	沪电股份	669,300	14,804,916.00	2.12
3	002028	思源电气	283,000	14,727,320.00	2.11
4	300394	天孚通信	151,100	13,828,672.00	1.98
5	000933	神火股份	817,800	13,739,040.00	1.96
6	600161	天坛生物	438,300	13,561,002.00	1.94
7	000975	银泰黄金	858,800	12,882,000.00	1.84
8	601168	西部矿业	895,100	12,773,077.00	1.83
9	002517	恺英网络	1,129,400	12,615,398.00	1.80
10	688169	石头科技	43,698	12,364,349.10	1.77
11	600988	赤峰黄金	840,700	11,778,207.00	1.68
12	002223	鱼跃医疗	324,000	11,203,920.00	1.60
13	300724	捷佳伟创	147,600	10,923,876.00	1.56
14	002078	太阳纸业	855,200	10,407,784.00	1.49
15	600873	梅花生物	1,031,800	9,853,690.00	1.41
16	603596	伯特利	140,800	9,757,440.00	1.40
17	603939	益丰药房	242,180	9,696,887.20	1.39
18	300866	安克创新	109,000	9,657,400.00	1.38
19	600096	云天化	618,700	9,651,720.00	1.38
20	300037	新宙邦	203,400	9,620,820.00	1.38
21	601128	常熟银行	1,489,800	9,519,822.00	1.36
22	600066	宇通客车	714,100	9,461,825.00	1.35
23	002966	苏州银行	1,434,840	9,269,066.40	1.33
24	600298	安琪酵母	250,100	8,798,518.00	1.26
25	688099	晶晨股份	138,316	8,662,731.08	1.24
26	600862	中航高科	390,700	8,654,005.00	1.24
27	002738	中矿资源	231,880	8,651,442.80	1.24
28	002262	恩华药业	312,100	8,464,152.00	1.21
29	300017	网宿科技	1,075,700	8,444,245.00	1.21
30	603688	石英股份	96,698	8,401,122.24	1.20
31	603816	顾家家居	239,100	8,368,500.00	1.20
32	603606	东方电缆	195,100	8,340,525.00	1.19
33	600529	山东药玻	317,500	8,128,000.00	1.16
34	688188	柏楚电子	31,613	8,001,566.43	1.14
35	600497	驰宏锌锗	1,576,100	7,959,305.00	1.14
36	600153	建发股份	821,700	7,912,971.00	1.13
37	600839	四川长虹	1,483,200	7,846,128.00	1.12
38	600486	扬农化工	122,900	7,757,448.00	1.11
39	002756	永兴材料	145,800	7,612,218.00	1.09
40	002600	领益智造	1,125,300	7,607,028.00	1.09
41	002472	双环传动	291,000	7,571,820.00	1.08
42	000831	中国稀土	272,400	7,537,308.00	1.08
43	000591	太阳能	1,289,200	7,193,736.00	1.03
44	002558	巨人网络	637,600	7,102,864.00	1.02

45	002568	百润股份	283,500	6,976,935.00	1.00
46	600398	海澜之家	938,100	6,960,702.00	1.00
47	688390	固德威	52,540	6,860,673.20	0.98
48	600985	淮北矿业	409,300	6,806,659.00	0.97
49	603338	浙江鼎力	132,300	6,769,791.00	0.97
50	000400	许继电气	306,700	6,735,132.00	0.96
51	600535	天士力	372,200	6,334,844.00	0.91
52	300001	特锐德	312,100	6,273,210.00	0.90
53	601717	郑煤机	495,200	6,264,280.00	0.90
54	002595	豪迈科技	208,200	6,198,114.00	0.89
55	601666	平煤股份	534,400	6,177,664.00	0.88
56	601577	长沙银行	900,900	6,144,138.00	0.88
57	300487	蓝晓科技	114,200	6,059,452.00	0.87
58	603233	大参林	238,164	5,930,283.60	0.85
59	689009	九号公司	199,807	5,926,275.62	0.85
60	300009	安科生物	564,100	5,765,102.00	0.82
61	002056	横店东磁	423,400	5,732,836.00	0.82
62	002372	伟星新材	388,300	5,618,701.00	0.80
63	688516	奥特维	61,040	5,524,120.00	0.79
64	002865	钧达股份	70,900	5,493,332.00	0.79
65	002572	索菲亚	328,100	5,233,195.00	0.75
66	600863	内蒙华电	1,331,500	5,192,850.00	0.74
67	000598	兴蓉环境	894,800	5,091,412.00	0.73
68	600563	法拉电子	54,900	5,083,740.00	0.73
69	600566	济川药业	158,700	4,987,941.00	0.71
70	601000	唐山港	1,399,300	4,897,550.00	0.70
71	002128	电投能源	340,800	4,863,216.00	0.70
72	601958	金钼股份	507,100	4,792,095.00	0.69
73	600258	首旅酒店	301,300	4,706,306.00	0.67
74	002831	裕同科技	170,400	4,687,704.00	0.67
75	002032	苏泊尔	88,400	4,686,084.00	0.67
76	002508	老板电器	213,720	4,654,821.60	0.67
77	603927	中科软	153,600	4,604,928.00	0.66
78	603568	伟明环保	272,700	4,363,200.00	0.62
79	603883	老百姓	145,710	4,355,271.90	0.62
80	300776	帝尔激光	72,100	4,344,746.00	0.62
81	300026	红日药业	1,023,400	4,339,216.00	0.62
82	600901	江苏金租	881,900	4,268,396.00	0.61
83	000739	普洛药业	266,500	4,101,435.00	0.59
84	002244	滨江集团	542,900	3,946,883.00	0.56
85	002155	湖南黄金	348,900	3,886,746.00	0.56
86	000563	陕国投 A	1,226,700	3,729,168.00	0.53
87	600977	中国电影	296,700	3,631,608.00	0.52

88	600598	北大荒	285,000	3,411,450.00	0.49
89	603228	景旺电子	149,200	3,365,952.00	0.48
90	603650	彤程新材	92,200	3,070,260.00	0.44
91	600062	华润双鹤	163,000	3,031,800.00	0.43
92	601928	凤凰传媒	315,700	2,781,317.00	0.40
93	600377	宁沪高速	225,600	2,312,400.00	0.33
94	001203	大中矿业	216,500	2,201,805.00	0.31
95	002563	森马服饰	372,600	2,149,902.00	0.31
96	601139	深圳燃气	258,700	1,782,443.00	0.25
97	603056	德邦股份	115,000	1,664,050.00	0.24
98	601061	中信金属	193,300	1,490,343.00	0.21
99	603868	飞科电器	25,100	1,267,550.00	0.18
100	600956	新天绿能	141,200	1,147,956.00	0.16

### 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	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.01
2	688548	广钢气体	2,996	38,199.00	0.01
3	301487	盟固利	867	35,512.32	0.01
4	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
5	688563	航材股份	555	33,571.95	0.00
6	301291	明阳电气	1,040	29,494.40	0.00
7	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
8	603296	华勤技术	344	26,746.00	0.00
9	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
10	688702	盛科通信	498	23,993.64	0.00
11	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
12	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
13	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
14	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
15	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
16	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
17	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
18	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
19	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
20	301525	儒竞科技	215	17,513.90	0.00
21	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
22	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
23	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
24	301559	中集环科	883	16,105.92	0.00

25	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
26	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
27	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
28	301371	敷尔佳	395	14,844.10	0.00
29	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
30	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
31	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
32	601083	锦江航运	1,186	13,129.02	0.00
33	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
34	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
35	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
36	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
37	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
38	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
39	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
40	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
41	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
42	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
43	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
44	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
45	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
46	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
47	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
48	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
49	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
50	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
51	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
52	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
53	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
54	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
55	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
56	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
57	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
58	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
59	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
60	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
61	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
62	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
63	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
64	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
65	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
66	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
67	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00

68	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
69	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
70	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
71	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
72	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
73	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
74	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
75	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
76	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
77	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
78	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
79	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
80	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
81	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
82	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
83	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
84	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
85	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
86	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
87	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
88	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
89	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
90	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
91	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
92	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
93	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
94	603373	安邦护卫	88	3,058.00	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	002422	科伦药业	22,475,102.00	2.38
2	600489	中金黄金	16,990,197.60	1.80
3	002463	沪电股份	16,507,872.60	1.75
4	601058	赛轮轮胎	15,612,949.00	1.65
5	000423	东阿阿胶	15,432,815.00	1.63
6	300394	天孚通信	15,323,162.30	1.62
7	300146	汤臣倍健	14,874,416.07	1.58
8	002028	思源电气	14,671,878.00	1.55



9	002517	恺英网络	14,213,174.00	1.51
10	000933	神火股份	13,670,304.00	1.45
11	600415	小商品城	13,541,466.00	1.43
12	002223	鱼跃医疗	13,206,427.00	1.40
13	600161	天坛生物	12,955,281.42	1.37
14	600988	赤峰黄金	12,502,404.00	1.32
15	688169	石头科技	12,461,421.28	1.32
16	601168	西部矿业	12,208,273.58	1.29
17	300017	网宿科技	11,974,979.00	1.27
18	002600	领益智造	11,328,397.00	1.20
19	300866	安克创新	11,228,801.00	1.19
20	000591	太阳能	11,105,035.00	1.18

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	300308	中际旭创	41,310,297.66	4.38
2	002422	科伦药业	21,198,285.09	2.25
3	300012	华测检测	19,575,099.04	2.07
4	002384	东山精密	17,297,112.85	1.83
5	300832	新产业	17,195,982.90	1.82
6	600489	中金黄金	15,693,427.35	1.66
7	002497	雅化集团	15,649,771.92	1.66
8	000423	东阿阿胶	15,092,707.00	1.60
9	603605	珀莱雅	14,343,883.90	1.52
10	300390	天华新能	14,332,561.36	1.52
11	601699	潞安环能	12,551,741.00	1.33
12	300146	汤臣倍健	11,650,320.48	1.23
13	002192	融捷股份	11,604,979.00	1.23
14	600060	海信视像	11,547,917.92	1.22
15	600563	法拉电子	11,192,015.00	1.19
16	300699	光威复材	11,105,433.20	1.18
17	002738	中矿资源	10,960,555.60	1.16
18	000878	云南铜业	10,783,754.80	1.14
19	600160	巨化股份	10,671,754.00	1.13
20	600415	小商品城	10,635,387.00	1.13

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	885,671,194.14
卖出股票收入（成交）总额	954,590,792.40

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 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	73,757.93
2	应收清算款	2,278,768.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	46,779.65
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,399,306.20

### 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的说明

#### 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

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	002463	沪电股份	2,674,308.00	0.38	转融通证券出借流通受限
2	601058	赛轮轮胎	2,615,550.00	0.37	转融通证券出借流通受限
3	601168	西部矿业	2,562,892.00	0.37	转融通证券出借流通受限
4	002517	恺英网络	2,532,239.00	0.36	转融通证券出借流通受限
5	300394	天孚通信	2,205,632.00	0.32	转融通证券出借流通受限
6	002028	思源电气	2,154,456.00	0.31	转融通证券出借流通受限
7	688169	石头科技	1,839,175.00	0.26	转融通证券出借流通受限
8	000975	银泰黄金	1,224,000.00	0.18	转融通证券出借流通受限

#### 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	301526	国际复材	43,267.35	0.01	新股流通受限
2	688548	广钢气体	38,199.00	0.01	新股流通受限
3	301487	盟固利	35,512.32	0.01	新股流通受限

4	688549	中巨芯	34,738.46	0.00	新股流通受限
5	688563	航材股份	33,571.95	0.00	新股流通受限

### 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

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		鹏扬中证 500 质量成长 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
2,438	358,219.44	17,722,400.00	2.03%	90,570,500.00	10.37%	765,046,100.00	87.60%

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。

### 9.2 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	刘佳鹏	5,100,000.00	0.58%
2	华泰证券股份有限公司	5,000,100.00	0.57%
3	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	3,614,900.00	0.41%
4	中信建投证券股份有限公司	3,497,400.00	0.40%
5	招商证券股份有限公司	2,737,300.00	0.31%
6	深圳市国立智能电力科技有限公司	2,000,000.00	0.23%
7	董继凤	1,771,300.00	0.20%
8	区力	1,200,000.00	0.14%
9	郑元瑞	1,090,700.00	0.12%
10	马庆明	1,000,000.00	0.11%
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	765,046,100.00	87.60%

注：前十名持有人依据本基金注册登记机构中国登记结算有限责任公司提供的证券持有人名册依次填写。

### 9.3 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。

### 9.4 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。

## § 10 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	86,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	271,000,000.00
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	873,339,000.00

## § 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：

报告期内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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 60,000.00 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

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

## 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	
中信建投	3	1,632,687,045.13	89.85%	1,195,617.70	93.06%	-
华泰证券	3	149,625,024.14	8.23%	63,805.22	4.97%	-
野村东方国际证券	2	30,689,074.07	1.69%	22,313.51	1.74%	-
兴业证券	2	4,190,687.47	0.23%	3,042.16	0.24%	-
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，兴业证券、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。

### 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		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	1,969,879.44	100.00%	383,921,000.00	87.12%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	39,841,000.00	9.04%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	16,896,000.00	3.83%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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

9	鹏扬基金管理有限公司关于暂停凤凰金信（海口）基金销售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	2023 年 7 月 3 日
10	鹏扬基金管理有限公司关于暂停浦领基金销售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	2023 年 7 月 3 日
11	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳前海微众银行股份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 7 月 6 日
12	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳市前海排排网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 7 月 19 日
13	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 2 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 7 月 19 日
14	鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金增加基金销售合作机构为申购赎回代办证券公司的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 7 月 26 日
15	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与阳光人寿保险股份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 7 月 28 日
16	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产品资料概要（更新）	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 8 月 4 日
17	鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书（2023 年第 1 号）	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 8 月 4 日
18	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	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 8 月 30 日
19	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华瑞保险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 9 月 6 日
20	鹏扬基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司相关销售业务的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 9 月 9 日
21	鹏扬基金管理有限公司关于开通上海浦东发展银行股份有限公司借记卡电子交易业务的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 9 月 14 日
22	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）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 9 月 15 日
23	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 3 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2023 年 10 月 25 日



24	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与嘉实财富管理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 12 月 18 日
25	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与嘉实财富管理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 12 月 19 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
鹏扬中证 500 质量成长 ETF 联接	1	2023 年 1 月 1 日-2023 年 12 月 31 日	946,246,100.00	38,000,000.00	219,200,000.00	765,046,100.00	87.60%

#### 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。本基金的运作方式为交易型开放式，赎回对价主要为组合证券，赎回行为对本基金的影响大幅减少。基金管理人通过编制申购赎回清单有效防控基金运作风险，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。

### 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。

### 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

2024 年 3 月 29 日