鹏扬中证A500指数增强型证券投资基金
2025年年度报告

2025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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026年3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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 23 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，容诚会计师事务所（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 2025 年 3 月 4 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 6
2.1 基金基本情况 6
2.2 基金产品说明 6
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 12
§4 管理人报告 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 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 20
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 20
§5 托管人报告 20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 20
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 20
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 20
§6 审计报告 20
6.1 审计报告基本信息 20
6.2 审计报告的基本内容 20
§7 年度财务报表 22
7.1 资产负债表 22
7.2 利润表 24

7.3 净资产变动表 25
7.4 报表附注 26
§8 投资组合报告 56
8.1 期末基金资产组合情况 56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 56
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 58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 78
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 78
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 79
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 79
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 79
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 79
8.12 投资组合报告附注 79
§9 基金份额持有人信息 80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 81
§10 开放式基金份额变动 81
§11 重大事件揭示 82
11.1 基金份额持有人大会决议 82
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 82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 82
11.4 基金投资策略的改变 82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 82
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 83
11.8 其他重大事件 84
§12 影响投资者决策的其他重要信息 85
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 85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 85
§13 备查文件目录 86
13.1 备查文件目录 86

13.2 存放地点 86
13.3 查阅方式 86

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	鹏扬中证 A500 指数增强	
基金主代码	022756	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 4 日	
基金管理人	鹏扬基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	121,729,155.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鹏扬中证 A500 指数增强 A	鹏扬中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022756	022757
报告期末下属分级基金的份额总额	94,819,836.39 份	26,909,319.60 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化方法进行积极的投资组合管理和风险控制，力争实现超越标的指数的投资回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证 A500 指数为标的指数，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，力求实现超越业绩比较基准的投资回报。主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略及其他投资策略等。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，如投资需承担汇率风险以及香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宋震	王小飞
	联系电话	400-968-6688	021-60637103
	电子邮箱	service@pyamc.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-968-6688	021-60637228
传真		010-68105915	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室	北京市西城区金融大街 25 号

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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100045	100033
法定代表人	杨爱斌	张金良

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	http://www.pyamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	鹏扬基金管理有限公司	北京市西城区复兴门外大街 A2 号西城金茂中心 16 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日	
	鹏扬中证 A500 指数增强 A	鹏扬中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	47,759,277.22	10,368,638.56
本期利润	48,305,454.30	14,020,869.75
加权平均基金份额本期利润	0.1427	0.0985
本期加权平均净值利润率	14.05%	9.80%
本期基金份额净值增长率	26.33%	25.89%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
期末可供分配利润	24,961,504.09	6,968,021.45
期末可供分配基金份额利润	0.2633	0.2589
期末基金资产净值	119,781,340.48	33,877,341.05
期末基金份额净值	1.2633	1.2589
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
基金份额累计净值增长率	26.33%	25.89%

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。

（4）本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，截至本报告期末基金合同生效未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

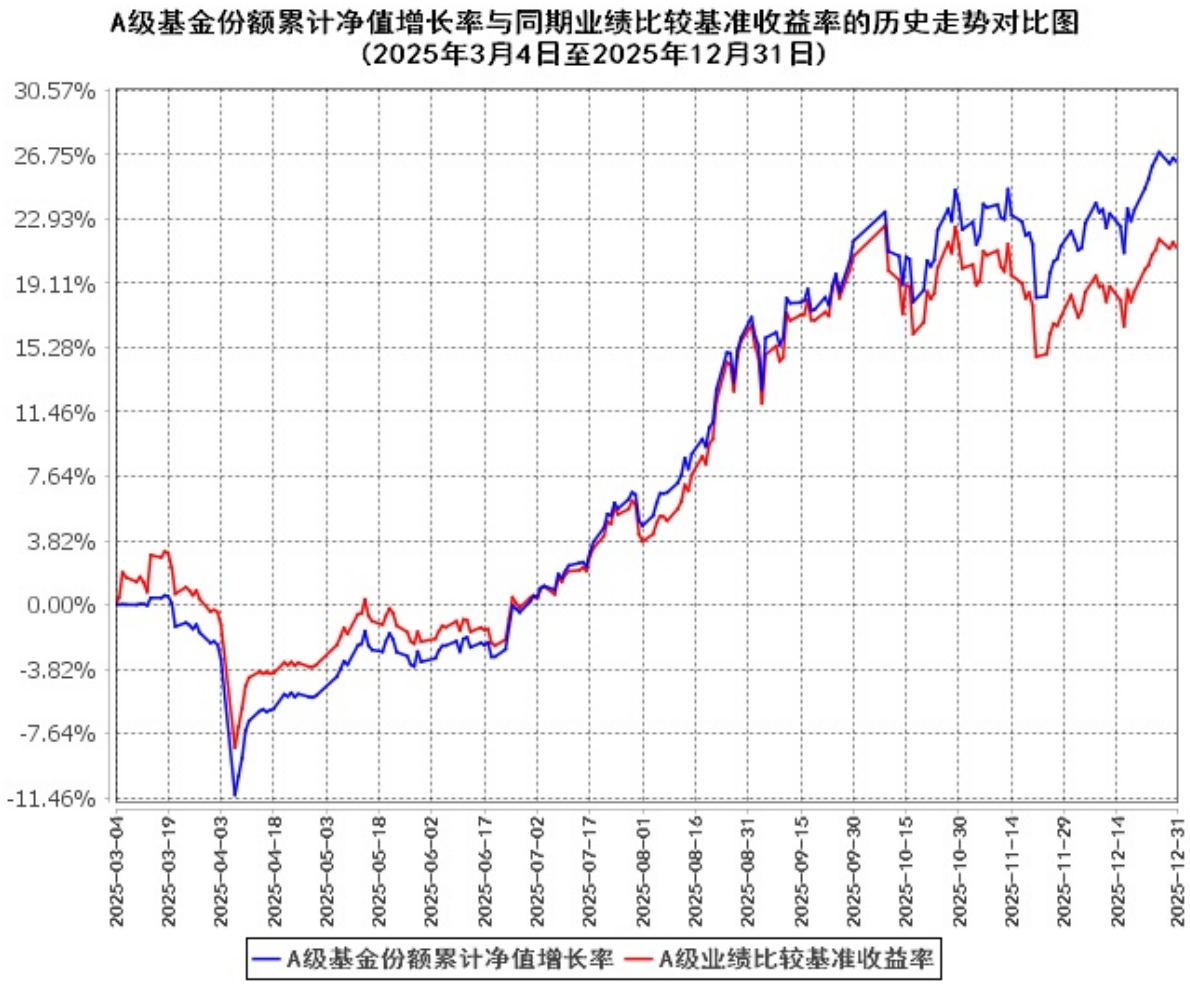
鹏扬中证 A500 指数增强 A

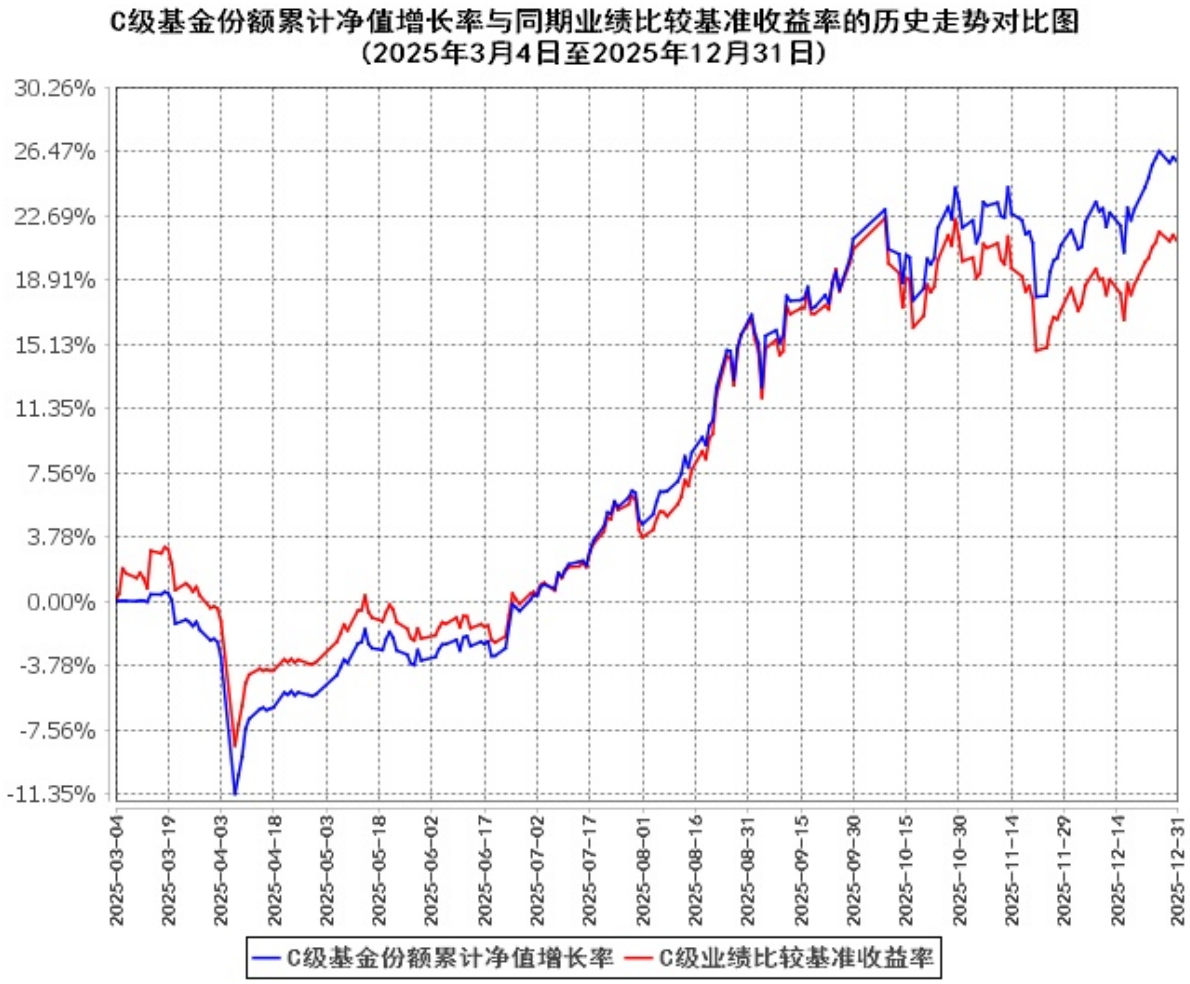
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.88%	0.98%	0.43%	1.00%	3.45%	-0.02%
过去六个月	26.09%	0.91%	20.71%	0.95%	5.38%	-0.04%
自基金合同生效起至今	26.33%	0.99%	21.22%	0.99%	5.11%	0.00%

鹏扬中证 A500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.77%	0.98%	0.43%	1.00%	3.34%	-0.02%
过去六个月	25.83%	0.91%	20.71%	0.95%	5.12%	-0.04%
自基金合同生效起至今	25.89%	0.99%	21.22%	0.99%	4.67%	0.00%

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

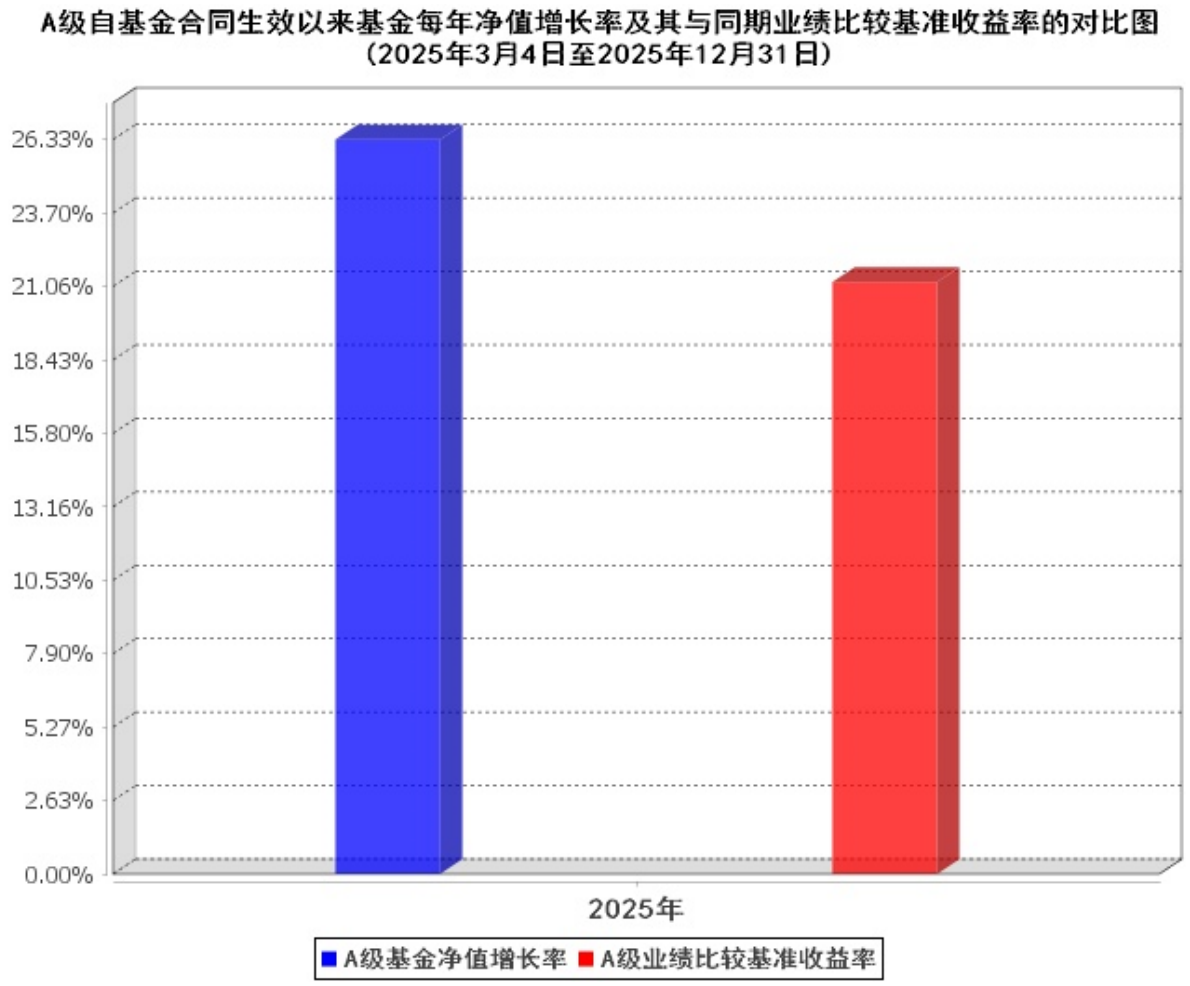


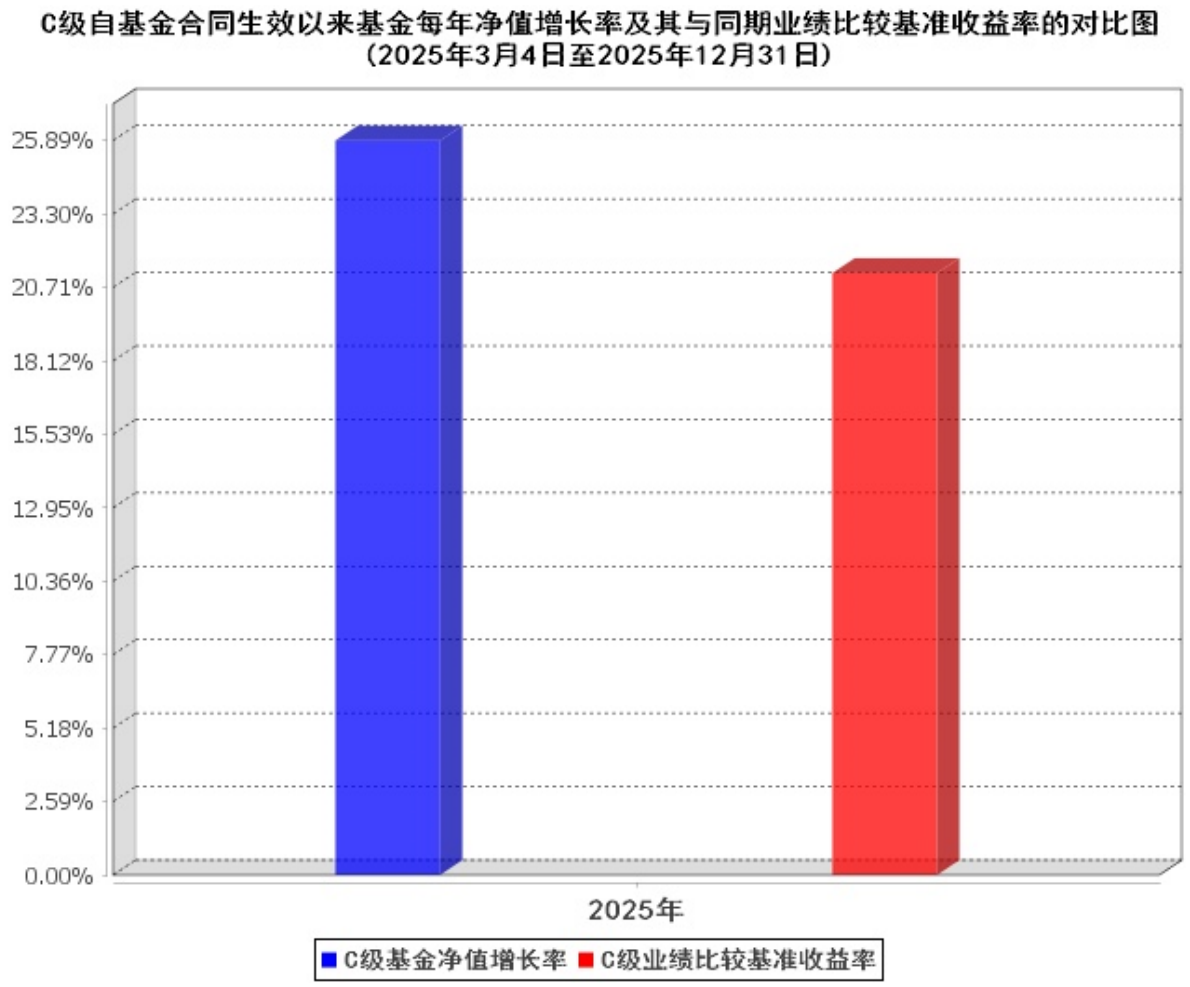


注：（1）本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，截至报告期末基金合同生效未满一年。

（2）按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同的有关规定。

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





注：本基金合同于 2025 年 3 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“公司”）成立于 2016 年 7 月 6 日，是经中国证监会批准成立的全国性公募基金公司，总部位于北京。截至 2025 年末，在优良业绩带动下，公司资产管理总规模 1934 亿元，非货公募 1216 亿元，创造投资收益 312 亿元，分红 133 亿元。客户总数超过 1400 万户。

公司践行高质量发展。在业务布局方面，公司形成了主动固收、主动权益、指数量化、多资产

四大业务板块，并沿着风险收益曲线持续细化产品布局。在人才战略方面，公司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。在投研管理方面，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，主动固收团队持续提升宏观研究与大类资产配置、利率交易、信用研究、转债增强、衍生品交易等核心投研能力，力求为投资人获取可持续、稳健的收益；主动权益团队建立充分共享、深度协作的研究文化与工作机制，致力于做深度的个股研究和产业研究，以产业洞察促进价值发现，在不同风格策略领域布局权益产品以适应客户的多元化需求；指数和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，并向客户提供投研和投教服务，努力为投资者提供风险收益特征清晰、长期持有体验良好的多样化投资工具，提升投资者的获得感；多资产团队在公司自上而下的宏观经济及大类资产配置研究成果基础上，将基于大数据的定量研究和基于深度调研的定性研究有机结合，强化多策略间的协作，为投资者提供便捷的多策略组合配置方案，有效分散投资风险，助力资产稳健增值。

公司坚持守法合规经营，高度注重风险管理，以金融科技赋能业务。公司严守法律合规底线，在管理上树立全员风险防范意识；在业务流程上实现了对投前、投中、投后的全流程风险管理覆盖；在评价方式上以结果为导向检验风险管理成效，杜绝风险事件的发生。公司成立以来对债券信用风险施行严格管控，投资的债券保持零踩雷。公司积极推进数字化转型，充分运用大数据、云计算、人工智能等前沿技术，形成了涵盖投研、交易、合规、客户服务的一系列金融科技成果，不断提升经营管理水平。

鹏扬基金作为一家有理想、有担当的公募基金公司，坚持党建引领业务发展，积极履行社会与行业责任，书写金融“五篇大文章”。在新“国九条”和资本市场“1+N”政策体系持续落地的背景下，公司发挥专业特色优势，面向保险、养老金、年金和理财等各类长期资金提供服务，主动做好资本市场政策宣讲，坚定不移地落实支持长期资金入市的党和国家战略。在养老金融领域，公司已有两只产品纳入个人养老金投资产品目录。2025年，公司在北京市、深圳市、陕西省、香港特别行政区等多地开展社会责任行动，涉及联合党建、乡村教育、金融文化、扶弱济贫、灾害援助等领域。作为中国基金业协会投教专委会委员单位，公司积极联合金融基础设施机构、新闻媒体、行业机构、高等院校等多方力量，开展投资者教育和保护工作，为行业高质量发展建言献策，打造投资和投教生态圈，相关成果案例获得《证券时报》《中国基金报》等多家主流媒体的表彰。

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，专注于长期目标，寻求服

务投资者的最佳方案，全力以赴争创一流投资机构，在资本市场和大资管行业高质量发展的进程中行稳致远，为金融强国建设贡献力量。

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		
马超	本基金基金经理,量化投资部副总经理	2025 年 3 月 4 日	-	8	中国人民大学管理科学与工程硕士。曾任创金合信基金管理有限公司量化分析师、投资经理，珠海宽德投资管理有限公司投资经理，创金合信基金管理有限公司量化指数与国际部总监助理、基金经理。现任鹏扬基金管理有限公司量化投资部副总经理。2024 年 4 月 16 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；2025 年 3 月 4 日至今任鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理；2025 年 6 月 30 日至今任鹏扬合利债券型证券投资基金基金经理；2025 年 10 月 23 日至今任鹏扬景科混合型证券投资基金基金经理。

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

(2)证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，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

2025 年，美国经济在高利率与政策不确定性并存的背景下展现出较强韧性，全年增长节奏有所放缓但未明显失速。就业市场逐步降温，但仍处于健康运行区间，新增就业率和失业率呈现“双低”态势。通胀在服务项增速放缓、商品价格走弱的共同作用下整体下行。特朗普政府的贸易与产业政策虽一度加剧市场波动，但未对实体经济形成持续冲击。与此同时，美元走弱改善了金融条件，财政层面未见明显收缩，叠加 AI、能源相关领域资本开支加速，多重因素共同支撑了美国经济在去通胀过程中平稳运行。

2025 年，我国经济稳中向好，实际 GDP 增速达到 5%，顺利完成全年增长目标。据国家统计局初步核算，名义 GDP 增速为 4%，GDP 平减指数为-1%。结构上看，净出口成为经济增长的主要拉动力，按人民币计价的出口同比增长 6.1%，增速高于名义 GDP；固定资产投资同比下降 3.8%，社会消费品零售总额同比增加 3.7%，二者增速均低于名义 GDP。通胀方面，经济供需矛盾仍存，需求不足是制约物价上行的主要原因，全年通胀水平维持低位运行；分项来看，CPI 同比回归正区间，PPI 同比仍处于深度负区间，从趋势上看，CPI 改善幅度偏弱，PPI 改善幅度相对较大。

政策方面，党的二十大以来，“质的有效提升”已逐步成为优先于经济增速的政策考量，因地制宜发展新质生产力、建设全国统一大市场的重要性上升。在社会生产领域“内卷式”竞争不断加剧的背景下，企业盈利空间受到挤压、社会物价水平处于低位，“反内卷”成为优化社会生产模式、提升资源配置效率的重要课题。从政策实施情况来看，财政政策结构性特征显著，资金重点投向科技创新和民生保障领域，同时紧盯地方政府债务及金融领域风险，稳步推进化债工作落地。货币政策全年保持适度宽松基调，累计实施降息 10 个基点、降准 50 个基点，同时依托公开市场操作维护市场流动性合理充裕，有效平滑短期资金面波动。当前宏观政策的一致性逐步强化，财政、货

币、产业、金融政策协同发力，以助力实体经济高质量发展为核心目标，为我国经济社会发展注入强劲动力。

2025 年，美股整体呈现高位拉锯态势，行情由宏观分母端的降息预期与微观分子端的 AI 业绩兑现共同驱动，但在历史高估值的约束下，市场波动显著加剧。科技巨头走势分化，市场广度边际改善，资金逐步流向利率敏感型中小盘标的。受益于美元指数走弱，新兴市场整体回暖。2025 年，AH 股迎来价值重估的关键年，市场主要矛盾从宏观预期不稳转向政策落地实效与企业盈利修复的实际验证。宽基层面，在财政发力与货币宽松的政策共振下，沪深 300 指数、恒生指数震荡上行，走出了估值修复行情。风格与行业层面，市场逻辑从单纯的红利避险向成长复苏方向扩散：上半年高股息资产保持韧性，下半年随着内需企稳，AI 应用、硬科技等科技成长板块与顺周期板块接力上涨。港股受益于美联储降息带来的流动性外溢效应，表现弹性优于 A 股，AH 溢价率高位回落。整体来看，2025 年全球资本市场的核心驱动是全球流动性宽松与地缘经济格局的重塑。当前，美股高估值仍需时间通过业绩消化，而 AH 股虽完成阶段性修复，但其动态市盈率仍处于历史中枢偏下区间，在全球资产比价体系中具备显著的安全边际与配置性价比。

操作方面，本基金本报告期内通过多维度控制相对基准指数的偏移度，力争将跟踪误差控制在相对合理平稳水平；收益方面通过多元化途径挖掘超额收益，力争实现相对基准指数的超额收益。2025 年基金跟踪误差控制合理，在行业、风格和个股层面均未出现较大偏移。报告期内，基准指数整体上行，市场成交活跃度稳定提升，科技、制造等多个主题轮流成为市场投资主线，股票投资机会较为丰富，有利于量化策略获取超额收益。本基金超额收益来源多元且相对分散，在不同市场环境和波动特征下，整体展现出较好的韧性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.2633 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.33%；截至本报告期末鹏扬中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.2589 元，本报告期基金份额净值增长率为 25.89%；同期业绩比较基准收益率为 21.22%。

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 2026 年美国经济，预计整体仍将展现出较强韧性。一方面，中期选举临近推动财政政策较 2025 年更加积极，金融条件延续宽松也有助于激发私人部门的支出潜力；另一方面，美国就业市场面临科技革命带来的 K 型分化结构性压力，且年内企业债集中到期，企业债务再融资压力或对广义流动性形成掣肘，这也意味着美联储大概率将延续宽松的政策基调。

2026 年国内经济预计延续稳中向好态势，增长动能迎来切换，内需将成为核心支撑，供需矛

盾有望逐步缓解，政策层面将聚焦财政支出结构优化。财政政策将保持必要支出力度，通过适度提高赤字率、扩大超长期特别国债发行等工具积极作为，并与适度宽松的货币政策协同发力，重点支持科技创新、绿色发展和民生保障等领域。消费在政策助力下渐进复苏，服务消费有望成为新亮点。投资聚焦于“两重”建设（国家重大战略、重点安全能力建设）和制造业高端化升级。房地产行业则继续向“控增量、优存量”模式调整。出口在多元化市场布局和“新三样”等高端产品的带动下保持韧性。随着供需关系改善与政策支持，物价有望步入温和回升通道，与经济增长形成良性互动。在“十五五”规划项目加速落地、政策效应持续释放的背景下，中国经济将在质升量稳中实现良好开局。

展望2026年权益市场，盈利回升有望继续推动A股走强。2025年工业企业利润同比增速0.6%，终结此前连续三年的负增长态势，为市场盈利修复释放积极信号；在宏观预期改善和盈利稳步抬升的背景下，消费板块可能存在结构性配置机会。价格维度来看，PPI触底回升成为全年的“确定性交易”主线，叠加新一轮科技革命推进，有色、油气等资源股存在配置机会。汇率角度来看，美联储降息叠加我国长债利率见底，套息资金逐步回流，在美元趋势性贬值的进程中，人民币有望迎来系统性的升值机遇，这一进程或伴随出口商加速结汇，为人民币资产价值重估奠定基础。资金面来看，国内中长期存款集中到期、资金面持续宽裕，保险产品凭借相对较高的收益率成为居民理财的新选择，将利好保险板块表现。从风险收益比分析，全球价值风格股票及新兴市场股票的性价比处于合理区间，叠加基本面改善趋势明确及资金流入预期较强，具备一定配置价值，但行业结构差异不容忽视。

基金运作方面，后续我们将继续对组合实施精细化管理，保持跟踪误差处于相对合理水平；同时持续加大研发投入，强化投研产出能力，不断挖掘多元化、低相关的收益来源，努力提升超额收益的性价比，增强策略对各种复杂市场环境的适应能力。

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》、《资产管理产品相关会计处理规定》、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。定价服务机构按照协议约定提供定价服务。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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	容诚审字[2026]200Z0121 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A500指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了鹏扬中证A500指数增强型证券投资基金财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 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A500指数增强型证券投资基金2025年12月31日的财务状况以及2025年3月4日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于鹏扬中证A500指数增强型证券投资基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	鹏扬中证A500指数增强型证券投资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”)管理层对其他信息负责。其他信息包括鹏扬中证A500指数增强型证券投资基金2025年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	鹏扬中证A500指数增强型证券投资基金的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重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估鹏扬中证A500指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算鹏扬中证A500指数增强型证券投资基金、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A500指数增强型证券投资基金的财务报告过程。

注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价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。 （4）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 A500 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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。	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	周祎	贺斯吴仪
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26	
审计报告日期	2026 年 3 月 26 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	10,675,162.30
结算备付金		238,461.70
存出保证金		344,280.00
交易性金融资产	7.4.7.2	141,692,190.65
其中：股票投资		141,692,190.65
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	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		3,327,088.76
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		156,277,183.41
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 12 月 31 日**
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		2,465,290.48
应付管理人报酬		102,670.09
应付托管费		19,250.65
应付销售服务费		10,510.66
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	20,780.00
负债合计		2,618,501.88
净资产：		

实收基金	7.4.7.7	121,729,155.99
未分配利润	7.4.7.8	31,929,525.54
净资产合计		153,658,681.53
负债和净资产总计		156,277,183.41

注：（1）报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 121,729,155.99 份，其中鹏扬中证 A500 指数增强 A 基金份额净值 1.2633 元，基金份额总额 94,819,836.39 份；鹏扬中证 A500 指数增强 C 基金份额净值 1.2589 元，基金份额总额 26,909,319.60 份。

（2）本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，本报告期自 2025 年 3 月 4 日至 2025 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		66,638,940.62
1.利息收入		1,413,733.28
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,053,493.67
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		360,239.61
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		61,020,455.93
其中：股票投资收益	7.4.7.10	49,384,713.23
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	37,219.77
资产支持证券投资收益	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	2,759,274.68
股利收益	7.4.7.15	8,839,248.25
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	4,198,408.27
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	6,343.14
减：二、营业总支出		4,312,616.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,140,017.65
2. 托管费	7.4.10.2.2	588,753.33

3．销售服务费	7.4.10.2.3	451,055.01
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		11,370.29
8．其他费用	7.4.7.19	121,420.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,326,324.05
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,326,324.05
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		62,326,324.05

注：本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，本报告期自 2025 年 3 月 4 日至 2025 年 12 月 31 日。

7.3 净资产变动表

会计主体：鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,940,221,325.62	-	-	1,940,221,325.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 1,818,492,169.63	-	31,929,525.54	- 1,786,562,644.09
（一）、综合收益总额	-	-	62,326,324.05	62,326,324.05
（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）	- 1,818,492,169.63	-	-30,396,798.51	- 1,848,888,968.14
其中：1.基金申购款	228,506,595.37	-	25,807,901.96	254,314,497.33
2.基金赎回款	- 2,046,998,765.00	-	-56,204,700.47	- 2,103,203,465.47

（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	121,729,155.99	-	31,929,525.54	153,658,681.53

注：本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，本报告期自 2025 年 3 月 4 日至 2025 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨爱斌	崔雁巍	韩欢
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金(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[2024]第 1676 号《关于准予鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的批复》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 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,939,714,223.81 元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2025)验字第 70023812_A01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,940,221,325.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 507,101.81 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏扬基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称港股通标的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、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、政府支持债券、政府支持机构债券、可转债、可交换债、可分离交易可转债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、信用衍生品）、货币市

场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及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，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。其中，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终，在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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 2026 年 3 月 26 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。本期财务报表的实际编制期间系 2025 年 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2025 年 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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

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，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。

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、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

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

3、本基金的同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。

4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，经与基金托管人协商一致后，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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金融工具的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国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[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号

《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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，股票的股息、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、红利收入，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、红利收入继续暂减按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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

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 2025 年 12 月 31 日
活期存款	8,324,327.86
等于：本金	8,323,392.86
加：应计利息	935.00
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	2,350,834.44
等于：本金	2,350,610.32
加：应计利息	224.12
减：坏账准备	-
合计	10,675,162.30

注：其他存款为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		137,484,282.38	-	141,692,190.65	4,207,908.27
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	137,484,282.38	-	141,692,190.65	4,207,908.27

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,878,500.00	-	-	-
其中：股指期货	2,878,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,878,500.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2603	IF2603	1	1,377,960.00	-7,140.00
IC2601	IC2601	1	1,491,040.00	-2,360.00
合计				-9,500.00
减：可抵销期货暂收款				-9,500.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预收股利	780.00
预提费用	20,000.00
合计	20,780.00

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

鹏扬中证 A500 指数增强 A		
项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,010,432,667.90	1,010,432,667.90
本期申购	76,966,133.28	76,966,133.28
本期赎回(以"-"号填列)	-992,578,964.79	-992,578,964.79
本期末	94,819,836.39	94,819,836.39

金额单位：人民币元

鹏扬中证 A500 指数增强 C		
项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	929,788,657.72	929,788,657.72
本期申购	151,540,462.09	151,540,462.09
本期赎回(以"-"号填列)	-1,054,419,800.21	-1,054,419,800.21
本期末	26,909,319.60	26,909,319.60

注：（1）总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

（2）本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,940,221,325.62 份基金份额，其中有效认购资金折合 1,939,714,223.81 份基金份额，认购资金利息折合 507,101.81 份基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

鹏扬中证 A500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	47,759,277.22	546,177.08	48,305,454.30
本期基金份额交易产生的变动数	-18,786,330.86	-4,557,619.35	-23,343,950.21
其中：基金申购款	6,971,838.75	-1,273,574.70	5,698,264.05
基金赎回款	-25,758,169.61	-3,284,044.65	-29,042,214.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,972,946.36	-4,011,442.27	24,961,504.09

单位：人民币元

鹏扬中证 A500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	10,368,638.56	3,652,231.19	14,020,869.75
本期基金份额交易产生的变动数	-2,264,575.73	-4,788,272.57	-7,052,848.30
其中：基金申购款	20,835,788.92	-726,151.01	20,109,637.91
基金赎回款	-23,100,364.65	-4,062,121.56	-27,162,486.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,104,062.83	-1,136,041.38	6,968,021.45

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	105,769.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	31,342.96
结算备付金利息收入	916,380.93
其他	-
合计	1,053,493.67

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金产生的利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,991,257,225.43
减：卖出股票成本总额	2,938,470,533.87
减：交易费用	3,401,978.33
买卖股票差价收入	49,384,713.23

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 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	10.54
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	37,209.23
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	37,219.77

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 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	161,330.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	124,100.00
减：应计利息总额	10.93
减：交易费用	10.61
买卖债券差价收入	37,209.23

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

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	2,759,274.68

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	8,839,248.25
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,839,248.25

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	4,207,908.27
——股票投资	4,207,908.27
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-9,500.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-9,500.00
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	4,198,408.27

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	6,301.28
基金转出费收入	41.86
合计	6,343.14

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 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
审计费用	20,000.00
信息披露费	90,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	10,220.29
开户费	1,200.00
合计	121,420.29

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏扬基金管理有限公司（“鹏扬基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
杨爱斌	基金管理人股东
上海华石投资有限公司	基金管理人股东
宏实资本管理有限公司	基金管理人股东
上海璞识企业管理中心（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

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

本基金合同于 2025 年 3 月 4 日生效，无上年度可比期间。

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 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,140,017.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,531,072.23
应支付基金管理人的净管理费	1,608,945.42

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 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.80%/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 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	588,753.33

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 0.15%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.15%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏扬中证 A500 指数增强 A	鹏扬中证 A500 指数增强 C	合计
鹏扬基金	-	40.87	40.87
建设银行	-	367,867.11	367,867.11
合计	-	367,907.98	367,907.98

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

H=E×0.40%/当年天数

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	8,324,327.86	105,769.78

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 2025 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（2025 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
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	上市后九个月	新股锁定期流通受限	114.28	416.02	591	67,539.48	245,867.82	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	上市后九个月	新股锁定期流通受限	104.66	399.40	400	41,864.00	159,760.00	-
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	8.45	24.28	3,228	27,276.60	78,375.84	-
688783	西安	2025 年	上市后	新股	8.62	18.36	2,698	23,256.76	49,535.28	-

	奕材	10月20日	六个月	锁定期流通受限						
688765	禾元生物	2025年10月16日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	29.06	52.62	706	20,516.36	37,149.72	-
301656	联合动力	2025年9月17日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	12.48	25.46	1,276	15,924.48	32,486.96	-
001280	中国铀业	2025年11月25日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	17.89	45.36	607	10,859.23	27,533.52	-
688759	必贝特	2025年10月21日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	17.78	25.11	891	15,841.98	22,373.01	-
301632	广东建科	2025年8月5日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301584	建发致新	2025年9月18日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-

688790	昂瑞微	2025年12月9日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	83.06	117.19	97	8,056.82	11,367.43	-
301609	山大电力	2025年7月16日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-
688809	强一股份	2025年12月23日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	85.09	203.31	46	3,914.14	9,352.26	-
301638	南网数字	2025年11月11日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	5.69	14.21	655	3,726.95	9,307.55	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	13.75	18.53	497	6,833.75	9,209.41	-
001221	悍高集团	2025年7月23日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	14.99	34.87	259	3,882.41	9,031.33	-
688807	优迅股份	2025年12月10日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	51.66	135.56	64	3,306.24	8,675.84	-
301668	昊创瑞通	2025年9月15日	上市后六个月	新股锁定期流通受	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-

				限						
301667	纳百川	2025年12月10日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	22.63	57.07	120	2,715.60	6,848.40	-
301687	新广益	2025年12月24日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	21.93	54.39	125	2,741.25	6,798.75	-
301575	艾芬达	2025年9月3日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
603406	天富龙	2025年7月30日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	26.68	42.25	144	3,841.92	6,084.00	-
688805	健信超导	2025年12月17日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	18.58	32.37	183	3,400.14	5,923.71	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	36.80	65.23	89	3,275.20	5,805.47	-
601026	道生天合	2025年10月9日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	5.98	14.28	400	2,392.00	5,712.00	-
001233	海安集团	2025年11月18日	上市后六个月	新股锁定期流	48.00	51.88	105	5,040.00	5,447.40	-

				通受限						
603175	超颖电子	2025年10月17日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	17.08	48.56	108	1,844.64	5,244.48	-
603262	技源集团	2025年7月16日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
001388	信通电子	2025年6月24日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
603370	华新精科	2025年8月27日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
001369	双欣材料	2025年12月23日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	6.85	12.89	258	1,767.30	3,325.62	-
603418	友升股份	2025年9月16日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	46.36	59.06	52	2,410.72	3,071.12	-
603376	大明电子	2025年10月28日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
001285	瑞立科密	2025年9月23日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	42.28	56.08	50	2,114.00	2,804.00	-
603092	德力佳	2025年10月	上市后六个月	新股锁定	46.68	55.66	44	2,053.92	2,449.04	-

		30 日		期流通受限						
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	10.10	16.30	145	1,464.50	2,363.50	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	上市后六个月	新股锁定期流通受限	24.49	32.82	65	1,591.85	2,133.30	-

7.4.12.2 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
002049	紫光国微	2025 年 12 月 30 日	重大事项停牌流通受限	78.81	2026 年 1 月 15 日	86.69	48	4,168.35	3,782.88	-

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

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理

人通过制定政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程持续监控上述各类风险。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

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。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

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 2025 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	10,675,162.30	-	-	-	10,675,162.30
结算备付金	238,461.70	-	-	-	238,461.70
存出保证金	-	-	-	344,280.00	344,280.00
交易性金融资产	-	-	-	141,692,190.65	141,692,190.65
应收申购款	-	-	-	3,327,088.76	3,327,088.76
资产总计	10,913,624.00	-	-	145,363,559.41	156,277,183.41
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,465,290.48	2,465,290.48
应付管理人报酬	-	-	-	102,670.09	102,670.09
应付托管费	-	-	-	19,250.65	19,250.65
应付销售服务费	-	-	-	10,510.66	10,510.66
其他负债	-	-	-	20,780.00	20,780.00
负债总计	-	-	-	2,618,501.88	2,618,501.88
利率敏感度缺口	10,913,624.00	-	-	142,745,057.53	153,658,681.53

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 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净值比例 （%）
交易性金融资产－股票投资	141,692,190.65	92.21
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	141,692,190.65	92.21

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（2025 年 12 月 31 日）

	市场基准上升 5%	7,686,565.13
	市场基准下降 5%	-7,686,565.13

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 2025 年 12 月 31 日
第一层次	140,800,852.35
第二层次	3,782.88
第三层次	887,555.42
合计	141,692,190.65

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证券，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证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，确定相关证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 2025 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2025 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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	420,519.34	420,519.34
转出第三层次	-	275,076.46	275,076.46
当期利得或损失总额	-	742,112.54	742,112.54
其中：计入损益的利得或损失	-	742,112.54	742,112.54
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	887,555.42	887,555.42
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	-	555,815.02	555,815.02

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	887,555.42	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.00%~303.23%	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

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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

无。

§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	141,692,190.65	90.67
	其中：股票	141,692,190.65	90.67
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	-	-
	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	10,913,624.00	6.98
8	其他各项资产	3,671,368.76	2.35
9	合计	156,277,183.41	100.00

注：存放在证券经纪商的证券交易资金账户中的证券交易结算资金统计在“银行存款和结算备付金合计”项内。

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	5,058.00	0.00
B	采矿业	4,158,965.41	2.71
C	制造业	79,240,553.77	51.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,195,883.00	2.08
E	建筑业	1,575,178.00	1.03

F	批发和零售业	116,090.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	4,228,520.00	2.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,964,474.65	4.53
J	金融业	18,400,829.80	11.98
K	房地产业	1,052,767.00	0.69
L	租赁和商务服务业	2,009,996.00	1.31
M	科学研究和技术服务业	672,254.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	624,762.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	122,245,331.63	79.56

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	290,341.00	0.19
B	采矿业	39,545.52	0.03
C	制造业	15,095,704.27	9.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	152,856.00	0.10
F	批发和零售业	505,753.44	0.33
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	22,254.55	0.01
J	金融业	1,862,247.00	1.21
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	801,760.46	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	676,396.78	0.44
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	19,446,859.02	12.66

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	300750	宁德时代	12,700	4,664,202.00	3.04
2	600519	贵州茅台	3,200	4,406,976.00	2.87
3	300502	新易盛	8,100	3,490,128.00	2.27
4	601318	中国平安	48,700	3,331,080.00	2.17
5	300308	中际旭创	4,600	2,806,000.00	1.83
6	600036	招商银行	60,900	2,563,890.00	1.67
7	688981	中芯国际	19,178	2,355,633.74	1.53
8	603019	中科曙光	26,900	2,303,716.00	1.50
9	603799	华友钴业	32,000	2,184,320.00	1.42
10	000100	TCL 科技	462,200	2,098,388.00	1.37
11	688008	澜起科技	15,800	1,861,240.00	1.21
12	688256	寒武纪	1,323	1,793,392.65	1.17
13	300033	同花顺	5,500	1,771,990.00	1.15
14	600011	华能国际	232,600	1,735,196.00	1.13
15	600941	中国移动	17,100	1,727,955.00	1.12
16	300413	芒果超媒	70,500	1,721,610.00	1.12
17	601919	中远海控	109,900	1,668,282.00	1.09
18	601211	国泰海通	75,400	1,549,470.00	1.01
19	000725	京东方 A	350,800	1,476,868.00	0.96
20	000001	平安银行	128,500	1,466,185.00	0.95
21	601899	紫金矿业	40,000	1,378,800.00	0.90
22	002625	光启技术	28,200	1,375,032.00	0.89
23	300558	贝达药业	29,300	1,368,017.00	0.89
24	600276	恒瑞医药	22,800	1,358,196.00	0.88
25	601628	中国人寿	28,600	1,301,300.00	0.85
26	000338	潍柴动力	75,500	1,298,600.00	0.85
27	601658	邮储银行	228,700	1,246,415.00	0.81
28	000568	泸州老窖	10,600	1,231,932.00	0.80
29	600309	万华化学	16,000	1,226,880.00	0.80
30	600938	中国海油	40,300	1,216,254.00	0.79
31	688041	海光信息	5,405	1,212,936.05	0.79
32	300760	迈瑞医疗	6,200	1,180,790.00	0.77
33	600549	厦门钨业	27,700	1,137,362.00	0.74
34	601668	中国建筑	221,300	1,135,269.00	0.74

35	688169	石头科技	7,200	1,094,832.00	0.71
36	600487	亨通光电	44,000	1,088,120.00	0.71
37	600372	中航机载	76,700	1,029,314.00	0.67
38	300316	晶盛机电	28,000	1,029,000.00	0.67
39	600362	江西铜业	18,100	994,052.00	0.65
40	601816	京沪高铁	190,600	981,590.00	0.64
41	600150	中国船舶	29,300	974,518.00	0.63
42	601988	中国银行	167,800	961,494.00	0.63
43	000333	美的集团	12,300	961,245.00	0.63
44	601398	工商银行	119,200	945,256.00	0.62
45	688126	沪硅产业	43,600	943,504.00	0.61
46	002415	海康威视	31,100	928,024.00	0.60
47	600760	中航沈飞	16,500	926,475.00	0.60
48	002353	杰瑞股份	11,800	835,794.00	0.54
49	601319	中国人保	91,600	819,820.00	0.53
50	300014	亿纬锂能	12,200	802,272.00	0.52
51	600415	小商品城	50,100	799,095.00	0.52
52	002709	天赐材料	17,200	796,876.00	0.52
53	600019	宝钢股份	106,700	794,915.00	0.52
54	600104	上汽集团	52,100	792,962.00	0.52
55	688271	联影医疗	6,293	789,771.50	0.51
56	300567	精测电子	8,600	784,320.00	0.51
57	601766	中国中车	114,900	783,618.00	0.51
58	603288	海天味业	21,023	778,271.46	0.51
59	600893	航发动力	19,400	776,582.00	0.51
60	300073	当升科技	13,300	768,740.00	0.50
61	300408	三环集团	16,700	764,025.00	0.50
62	300207	欣旺达	29,100	760,965.00	0.50
63	600886	国投电力	57,900	759,648.00	0.49
64	600009	上海机场	22,900	750,204.00	0.49
65	601127	赛力斯	6,200	749,952.00	0.49
66	002916	深南电路	3,200	743,328.00	0.48
67	000878	云南铜业	35,974	737,826.74	0.48
68	002074	国轩高科	18,600	727,446.00	0.47
69	002738	中矿资源	9,200	722,660.00	0.47
70	002236	大华股份	38,100	721,614.00	0.47
71	600196	复星医药	27,100	717,879.00	0.47
72	600690	海尔智家	27,200	709,648.00	0.46
73	300136	信维通信	11,100	688,200.00	0.45
74	688047	龙芯中科	5,126	677,195.86	0.44
75	600141	兴发集团	19,400	670,852.00	0.44
76	000415	渤海租赁	165,600	670,680.00	0.44
77	300274	阳光电源	3,900	667,056.00	0.43

78	601633	长城汽车	29,300	663,059.00	0.43
79	603806	福斯特	47,400	661,704.00	0.43
80	300438	鹏辉能源	12,300	654,606.00	0.43
81	688009	中国通号	118,200	646,554.00	0.42
82	600406	国电南瑞	28,700	645,176.00	0.42
83	300015	爱尔眼科	56,900	624,762.00	0.41
84	300059	东方财富	26,760	620,296.80	0.40
85	600660	福耀玻璃	9,300	602,361.00	0.39
86	002812	恩捷股份	10,500	594,720.00	0.39
87	600030	中信证券	20,100	577,071.00	0.38
88	688599	天合光能	33,400	552,770.00	0.36
89	002027	分众传媒	73,300	540,221.00	0.35
90	000792	盐湖股份	18,811	529,717.76	0.34
91	601166	兴业银行	25,000	526,500.00	0.34
92	600585	海螺水泥	23,600	515,896.00	0.34
93	300866	安克创新	4,500	514,755.00	0.33
94	605117	德业股份	5,900	508,580.00	0.33
95	600570	恒生电子	15,600	470,340.00	0.31
96	002594	比亚迪	4,600	449,512.00	0.29
97	600839	四川长虹	49,100	446,810.00	0.29
98	601111	中国国航	47,500	445,075.00	0.29
99	300347	泰格医药	7,700	436,590.00	0.28
100	003816	中国广核	114,900	432,024.00	0.28
101	601088	中国神华	10,600	429,300.00	0.28
102	688120	华海清科	2,859	429,078.72	0.28
103	600031	三一重工	19,828	418,965.64	0.27
104	600177	雅戈尔	52,100	395,960.00	0.26
105	605499	东鹏饮料	1,400	374,346.00	0.24
106	001979	招商蛇口	40,800	352,512.00	0.23
107	000933	神火股份	11,600	318,652.00	0.21
108	603993	洛阳钼业	15,500	310,000.00	0.20
109	300083	创世纪	33,500	308,535.00	0.20
110	601186	中国铁建	38,500	295,295.00	0.19
111	601601	中国太保	7,000	293,370.00	0.19
112	000009	中国宝安	28,600	281,710.00	0.18
113	601985	中国核电	31,100	269,015.00	0.18
114	601857	中国石油	25,501	265,465.41	0.17
115	601728	中国电信	41,400	260,820.00	0.17
116	601600	中国铝业	21,200	259,064.00	0.17
117	601225	陕西煤业	11,700	249,444.00	0.16
118	002244	滨江集团	24,500	246,225.00	0.16
119	688111	金山办公	800	245,656.00	0.16
120	603986	兆易创新	1,100	235,675.00	0.15

121	603259	药明康德	2,600	235,664.00	0.15
122	000408	藏格矿业	2,700	227,880.00	0.15
123	002241	歌尔股份	6,700	192,491.00	0.13
124	002252	上海莱士	29,800	188,932.00	0.12
125	600233	圆通速递	11,100	182,262.00	0.12
126	600208	衢州发展	46,000	178,020.00	0.12
127	600048	保利发展	26,800	163,480.00	0.11
128	000975	山金国际	6,600	160,578.00	0.10
129	603501	豪威集团	1,100	138,490.00	0.09
130	000858	五粮液	1,300	137,722.00	0.09
131	600028	中国石化	21,400	132,252.00	0.09
132	002475	立讯精密	2,300	130,433.00	0.08
133	601607	上海医药	6,500	116,090.00	0.08
134	601390	中国中铁	21,400	115,774.00	0.08
135	002352	顺丰控股	2,800	107,296.00	0.07
136	002085	万丰奥威	6,200	99,262.00	0.06
137	601288	农业银行	11,000	84,480.00	0.05
138	600018	上港集团	15,500	84,010.00	0.05
139	000002	万科A	16,100	74,865.00	0.05
140	600392	盛和资源	2,600	55,978.00	0.04
141	002517	恺英网络	2,400	52,488.00	0.03
142	601155	新城控股	2,700	37,665.00	0.02
143	600864	哈投股份	5,000	33,150.00	0.02
144	002230	科大讯飞	600	30,174.00	0.02
145	300124	汇川技术	400	30,132.00	0.02
146	600497	驰宏锌锗	4,100	29,971.00	0.02
147	601800	中国交建	3,500	28,840.00	0.02
148	002465	海格通信	1,700	26,775.00	0.02
149	601567	三星医疗	1,100	25,322.00	0.02
150	600741	华域汽车	1,100	22,000.00	0.01
151	688266	泽璟制药	200	18,540.00	0.01
152	601328	交通银行	2,400	17,400.00	0.01
153	002155	湖南黄金	800	16,872.00	0.01
154	600050	中国联通	3,300	16,863.00	0.01
155	002414	高德红外	1,000	14,670.00	0.01
156	688180	君实生物	400	13,664.00	0.01
157	688036	传音控股	203	13,430.48	0.01
158	688235	百济神州	40	10,744.00	0.01
159	600000	浦发银行	800	9,952.00	0.01
160	601018	宁波港	2,700	9,801.00	0.01
161	002714	牧原股份	100	5,058.00	0.00
162	002601	龙佰集团	200	3,916.00	0.00
163	002049	紫光国微	48	3,782.88	0.00

164	301358	湖南裕能	54	3,491.64	0.00
165	002595	豪迈科技	30	2,535.30	0.00

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	688347	华虹公司	10,400	1,121,848.00	0.73
2	002849	威星智能	55,000	874,500.00	0.57
3	002428	云南锗业	24,900	790,575.00	0.51
4	300835	龙磁科技	11,700	767,286.00	0.50
5	002209	达意隆	39,500	636,740.00	0.41
6	688428	诺诚健华	30,956	635,217.12	0.41
7	688639	华恒生物	19,400	632,052.00	0.41
8	300672	国科微	5,700	613,434.00	0.40
9	300417	南华仪器	42,000	587,580.00	0.38
10	002614	奥佳华	78,200	571,642.00	0.37
11	300006	莱美药业	109,600	563,344.00	0.37
12	301228	实朴检测	14,500	559,845.00	0.36
13	300626	华瑞股份	34,200	544,122.00	0.35
14	600919	江苏银行	52,200	542,880.00	0.35
15	301308	江波龙	2,200	538,648.00	0.35
16	688602	康鹏科技	60,600	526,008.00	0.34
17	601901	方正证券	66,900	521,820.00	0.34
18	688069	德林海	23,146	519,164.78	0.34
19	601009	南京银行	43,400	496,062.00	0.32
20	603306	华懋科技	6,800	428,468.00	0.28
21	688270	臻镭科技	3,400	415,038.00	0.27
22	301088	戎美股份	23,700	406,455.00	0.26
23	688496	清越科技	63,600	377,784.00	0.25
24	300387	富邦科技	43,800	372,738.00	0.24
25	000895	双汇发展	11,800	312,346.00	0.20
26	002772	众兴菌业	19,900	290,341.00	0.19
27	003011	海象新材	12,700	279,908.00	0.18
28	000703	恒逸石化	25,000	269,250.00	0.18
29	301007	德迈仕	6,600	267,432.00	0.17
30	300723	一品红	7,900	265,045.00	0.17
31	600768	宁波富邦	18,700	261,800.00	0.17
32	688795	摩尔线程	591	245,867.82	0.16
33	688084	晶品特装	2,200	182,160.00	0.12
34	002142	宁波银行	6,400	179,776.00	0.12
35	688802	沐曦股份	400	159,760.00	0.10

36	603150	万朗磁塑	4,200	159,516.00	0.10
37	300614	百川畅银	12,400	157,232.00	0.10
38	605598	上海港湾	2,200	152,856.00	0.10
39	603172	万丰股份	7,900	140,620.00	0.09
40	603119	浙江荣泰	1,200	138,804.00	0.09
41	301160	翔楼新材	1,900	136,591.00	0.09
42	002440	闰土股份	15,200	113,544.00	0.07
43	002811	郑中设计	7,500	111,300.00	0.07
44	301167	建研设计	6,200	100,750.00	0.07
45	002488	金固股份	11,000	96,690.00	0.06
46	301536	星宸科技	1,500	89,865.00	0.06
47	301285	鸿日达	1,300	88,114.00	0.06
48	301295	美硕科技	2,700	80,460.00	0.05
49	688729	屹唐股份	3,228	78,375.84	0.05
50	000166	申万宏源	14,700	77,469.00	0.05
51	603683	晶华新材	3,000	76,740.00	0.05
52	300201	海伦哲	9,600	65,568.00	0.04
53	688439	振华风光	959	61,951.40	0.04
54	002182	宝武镁业	3,900	59,670.00	0.04
55	600128	苏豪弘业	5,200	57,148.00	0.04
56	688783	西安奕材	2,698	49,535.28	0.03
57	600095	湘财股份	4,000	44,240.00	0.03
58	688775	影石创新	173	40,637.70	0.03
59	688765	禾元生物	706	37,149.72	0.02
60	301656	联合动力	1,276	32,486.96	0.02
61	000012	南玻A	6,700	29,681.00	0.02
62	001280	中国铀业	607	27,533.52	0.02
63	300999	金龙鱼	900	25,866.00	0.02
64	688759	必贝特	891	22,373.01	0.01
65	603063	禾望电气	500	16,535.00	0.01
66	301632	广东建科	656	15,534.08	0.01
67	600313	农发种业	2,400	15,456.00	0.01
68	301183	东田微	99	15,353.91	0.01
69	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.01
70	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.01
71	002373	千方科技	1,100	12,947.00	0.01
72	000552	甘肃能化	5,200	12,012.00	0.01
73	301584	建发致新	447	11,988.54	0.01
74	300594	朗进科技	600	11,766.00	0.01
75	688790	昂瑞微	97	11,367.43	0.01
76	301609	山大电力	277	11,354.23	0.01
77	688809	强一股份	46	9,352.26	0.01
78	301638	南网数字	655	9,307.55	0.01

79	001386	马可波罗	497	9,209.41	0.01
80	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.01
81	688727	恒坤新材	259	9,031.33	0.01
82	688807	优迅股份	64	8,675.84	0.01
83	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
84	301667	纳百川	120	6,848.40	0.00
85	301687	新广益	125	6,798.75	0.00
86	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
87	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
88	688796	百奥赛图	144	6,084.00	0.00
89	688551	科威尔	161	5,929.63	0.00
90	688805	健信超导	183	5,923.71	0.00
91	301449	天溯计量	89	5,805.47	0.00
92	601026	道生天合	400	5,712.00	0.00
93	001233	海安集团	105	5,447.40	0.00
94	603175	超颖电子	108	5,244.48	0.00
95	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
96	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
97	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
98	688661	和林微纳	66	3,416.16	0.00
99	300911	亿田智能	100	3,330.00	0.00
100	001369	双欣材料	258	3,325.62	0.00
101	603418	友升股份	52	3,071.12	0.00
102	603255	鼎际得	100	2,932.00	0.00
103	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
104	001285	瑞立科密	50	2,804.00	0.00
105	603092	德力佳	44	2,449.04	0.00
106	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
107	603248	锡华科技	145	2,363.50	0.00
108	603334	丰倍生物	65	2,133.30	0.00
109	300739	明阳电路	85	1,562.30	0.00
110	300679	电连技术	10	486.80	0.00
111	688299	长阳科技	28	473.76	0.00
112	300889	爱克股份	14	289.80	0.00
113	600966	博汇纸业	28	191.24	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)

1	300750	宁德时代	35,854,167.60	23.33
2	600519	贵州茅台	32,161,195.00	20.93
3	002594	比亚迪	24,564,968.00	15.99
4	300274	阳光电源	23,311,150.00	15.17
5	601899	紫金矿业	22,326,235.00	14.53
6	600036	招商银行	22,032,369.00	14.34
7	300476	胜宏科技	20,090,017.00	13.07
8	300308	中际旭创	20,049,643.00	13.05
9	601318	中国平安	18,143,142.00	11.81
10	000100	TCL科技	17,851,561.50	11.62
11	000001	平安银行	16,852,943.82	10.97
12	000725	京东方A	16,624,259.00	10.82
13	601600	中国铝业	16,494,862.00	10.73
14	600276	恒瑞医药	16,127,666.60	10.50
15	002050	三花智控	15,564,423.00	10.13
16	000333	美的集团	15,104,898.00	9.83
17	300502	新易盛	15,057,186.49	9.80
18	603993	洛阳钼业	14,779,087.00	9.62
19	603259	药明康德	14,655,605.00	9.54
20	300059	东方财富	14,492,691.08	9.43
21	688981	中芯国际	14,341,974.06	9.33
22	601857	中国石油	13,277,624.00	8.64
23	601919	中远海控	13,158,460.10	8.56
24	002384	东山精密	13,157,555.00	8.56
25	600031	三一重工	13,146,024.05	8.56
26	603799	华友钴业	13,073,343.20	8.51
27	603986	兆易创新	12,651,912.00	8.23
28	603019	中科曙光	12,487,004.48	8.13
29	601985	中国核电	12,427,271.00	8.09
30	688008	澜起科技	12,408,955.04	8.08
31	600418	江淮汽车	12,253,428.00	7.97
32	300033	同花顺	12,230,436.00	7.96
33	600690	海尔智家	12,138,267.00	7.90
34	600919	江苏银行	12,112,912.00	7.88
35	000858	五粮液	11,942,964.00	7.77
36	603288	海天味业	11,852,521.28	7.71
37	002001	新和成	11,306,622.96	7.36
38	002027	分众传媒	11,248,780.00	7.32
39	002625	光启技术	11,151,508.00	7.26
40	601628	中国人寿	11,076,564.00	7.21
41	600030	中信证券	10,947,881.00	7.12
42	600009	上海机场	10,778,355.00	7.01
43	002230	科大讯飞	10,772,721.00	7.01

44	600150	中国船舶	10,754,625.00	7.00
45	688012	中微公司	10,747,120.58	6.99
46	600893	航发动力	10,521,477.00	6.85
47	600050	中国联通	10,508,086.00	6.84
48	300014	亿纬锂能	10,453,783.54	6.80
49	002415	海康威视	10,138,049.00	6.60
50	000425	徐工机械	9,957,728.00	6.48
51	601668	中国建筑	9,861,263.00	6.42
52	601319	中国人保	9,854,453.00	6.41
53	300760	迈瑞医疗	9,835,810.00	6.40
54	600941	中国移动	9,701,291.08	6.31
55	600547	山东黄金	9,683,101.88	6.30
56	603501	豪威集团	9,649,263.00	6.28
57	601398	工商银行	9,645,078.00	6.28
58	300015	爱尔眼科	9,505,170.08	6.19
59	002648	卫星化学	9,331,652.66	6.07
60	000651	格力电器	9,310,559.00	6.06
61	688655	迅捷兴	9,220,158.58	6.00
62	601328	交通银行	9,091,152.00	5.92
63	002463	沪电股份	8,840,426.00	5.75
64	301358	湖南裕能	8,776,050.52	5.71
65	600372	中航机载	8,745,907.00	5.69
66	688114	华大智造	8,555,210.04	5.57
67	688235	百济神州	8,527,657.38	5.55
68	300347	泰格医药	8,453,564.00	5.50
69	000975	山金国际	8,370,588.20	5.45
70	600018	上港集团	8,204,082.00	5.34
71	600482	中国动力	8,137,598.00	5.30
72	002008	大族激光	8,049,182.00	5.24
73	600905	三峡能源	7,965,624.00	5.18
74	688223	晶科能源	7,896,972.84	5.14
75	600015	华夏银行	7,855,892.00	5.11
76	601288	农业银行	7,768,744.00	5.06
77	601127	赛力斯	7,702,026.00	5.01
78	002252	上海莱士	7,631,514.00	4.97
79	601818	光大银行	7,618,909.00	4.96
80	002916	深南电路	7,568,792.00	4.93
81	600415	小商品城	7,504,307.00	4.88
82	600406	国电南瑞	7,497,378.00	4.88
83	601633	长城汽车	7,428,798.00	4.83
84	002558	巨人网络	7,356,321.00	4.79
85	601088	中国神华	7,272,134.00	4.73
86	688166	博瑞医药	7,240,292.74	4.71

87	688041	海光信息	7,187,268.90	4.68
88	002180	纳思达	7,182,761.00	4.67
89	300088	长信科技	7,139,342.00	4.65
90	300628	亿联网络	7,093,061.92	4.62
91	600489	中金黄金	7,051,244.00	4.59
92	601229	上海银行	7,018,026.95	4.57
93	688256	寒武纪	6,979,791.62	4.54
94	300558	贝达药业	6,918,942.00	4.50
95	002074	国轩高科	6,900,566.00	4.49
96	000807	云铝股份	6,721,610.00	4.37
97	601766	中国中车	6,690,239.00	4.35
98	000625	长安汽车	6,631,277.00	4.32
99	601166	兴业银行	6,630,313.00	4.31
100	002460	赣锋锂业	6,506,177.00	4.23
101	601988	中国银行	6,494,572.00	4.23
102	300394	天孚通信	6,394,232.00	4.16
103	002475	立讯精密	6,389,977.00	4.16
104	002007	华兰生物	6,371,014.04	4.15
105	300999	金龙鱼	6,334,219.00	4.12
106	600938	中国海油	6,279,496.00	4.09
107	600166	福田汽车	6,241,798.00	4.06
108	601800	中国交建	6,190,070.00	4.03
109	688171	纬德信息	6,185,940.16	4.03
110	300255	常山药业	6,146,007.00	4.00
111	600600	青岛啤酒	6,141,185.00	4.00
112	002920	德赛西威	6,130,333.00	3.99
113	300408	三环集团	6,125,412.00	3.99
114	600584	长电科技	6,075,442.00	3.95
115	600887	伊利股份	6,069,680.00	3.95
116	601658	邮储银行	6,048,313.00	3.94
117	603688	石英股份	5,972,089.00	3.89
118	600011	华能国际	5,940,042.00	3.87
119	600660	福耀玻璃	5,931,206.00	3.86
120	600795	国电电力	5,919,302.00	3.85
121	603380	易德龙	5,883,774.00	3.83
122	600460	士兰微	5,881,314.00	3.83
123	601825	沪农商行	5,772,340.00	3.76
124	688220	翱捷科技	5,763,206.72	3.75
125	601225	陕西煤业	5,734,838.00	3.73
126	000988	华工科技	5,691,797.03	3.70
127	000792	盐湖股份	5,661,109.15	3.68
128	302132	中航成飞	5,642,436.00	3.67
129	002156	通富微电	5,563,565.00	3.62

130	688347	华虹公司	5,518,122.37	3.59
131	300395	菲利华	5,490,643.00	3.57
132	601211	国泰海通	5,422,608.00	3.53
133	601216	君正集团	5,395,854.00	3.51
134	002244	滨江集团	5,381,952.00	3.50
135	000686	东北证券	5,377,504.00	3.50
136	688111	金山办公	5,343,446.86	3.48
137	301365	矩阵股份	5,341,503.00	3.48
138	002532	天山铝业	5,292,107.00	3.44
139	605499	东鹏饮料	5,283,498.00	3.44
140	300037	新宙邦	5,273,255.00	3.43
141	300498	温氏股份	5,266,508.00	3.43
142	002407	多氟多	5,265,727.60	3.43
143	688180	君实生物	5,224,702.64	3.40
144	002049	紫光国微	5,219,591.96	3.40
145	600771	广誉远	5,205,327.00	3.39
146	600570	恒生电子	5,140,330.42	3.35
147	603806	福斯特	5,139,279.00	3.34
148	600298	安琪酵母	5,094,087.00	3.32
149	601728	中国电信	5,078,532.00	3.31
150	002714	牧原股份	5,060,204.68	3.29
151	688737	中自科技	5,024,796.41	3.27
152	300251	光线传媒	5,020,479.00	3.27
153	600111	北方稀土	4,962,163.00	3.23
154	600529	山东药玻	4,948,472.00	3.22
155	600048	保利发展	4,911,675.00	3.20
156	600378	昊华科技	4,899,559.00	3.19
157	000933	神火股份	4,892,114.00	3.18
158	300418	昆仑万维	4,891,509.10	3.18
159	600183	生益科技	4,880,088.00	3.18
160	000630	铜陵有色	4,874,019.00	3.17
161	688047	龙芯中科	4,873,075.14	3.17
162	001203	大中矿业	4,847,818.00	3.15
163	000877	天山股份	4,814,091.99	3.13
164	002352	顺丰控股	4,789,094.00	3.12
165	600988	赤峰黄金	4,774,278.00	3.11
166	603529	爱玛科技	4,760,773.00	3.10
167	000568	泸州老窖	4,725,064.00	3.08
168	000009	中国宝安	4,703,434.00	3.06
169	688208	道通科技	4,692,489.85	3.05
170	300390	天华新能	4,672,815.70	3.04
171	601888	中国中免	4,613,854.90	3.00
172	600335	国机汽车	4,605,203.00	3.00

173	601360	三六零	4,568,934.00	2.97
174	601669	中国电建	4,557,613.00	2.97
175	300759	康龙化成	4,524,390.00	2.94
176	601808	中海油服	4,499,649.31	2.93
177	600019	宝钢股份	4,485,644.00	2.92
178	600196	复星医药	4,469,690.00	2.91
179	000729	燕京啤酒	4,462,299.00	2.90
180	300136	信维通信	4,460,563.00	2.90
181	601006	大秦铁路	4,449,648.00	2.90
182	002155	湖南黄金	4,429,771.90	2.88
183	002028	思源电气	4,417,578.00	2.87
184	600332	白云山	4,409,273.00	2.87
185	000977	浪潮信息	4,376,379.00	2.85
186	600066	宇通客车	4,320,945.00	2.81
187	000408	藏格矿业	4,308,749.00	2.80
188	300946	恒而达	4,278,688.80	2.78
189	002850	科达利	4,268,923.00	2.78
190	000338	潍柴动力	4,254,435.00	2.77
191	688608	恒玄科技	4,253,841.31	2.77
192	301259	艾布鲁	4,250,279.00	2.77
193	002105	信隆健康	4,221,113.00	2.75
194	688375	国博电子	4,214,236.11	2.74
195	600674	川投能源	4,188,283.00	2.73
196	002422	科伦药业	4,140,401.00	2.69
197	600745	闻泰科技	4,139,581.56	2.69
198	000031	大悦城	4,134,489.00	2.69
199	301345	涛涛车业	4,128,699.00	2.69
200	601989	中国重工	4,111,959.00	2.68
201	601016	节能风电	4,110,927.00	2.68
202	002432	九安医疗	4,104,960.00	2.67
203	000538	云南白药	4,095,453.00	2.67
204	601083	锦江航运	4,087,888.00	2.66
205	002607	中公教育	4,076,123.00	2.65
206	601111	中国国航	4,065,160.00	2.65
207	300146	汤臣倍健	4,054,255.00	2.64
208	688158	优刻得	4,040,969.56	2.63
209	300124	汇川技术	4,040,347.00	2.63
210	300420	五洋自控	3,962,733.00	2.58
211	000661	长春高新	3,957,325.00	2.58
212	688156	路德科技	3,952,866.88	2.57
213	002544	普天科技	3,932,508.00	2.56
214	601816	京沪高铁	3,920,156.00	2.55
215	002992	宝明科技	3,914,965.00	2.55

216	600325	华发股份	3,897,639.00	2.54
217	601138	工业富联	3,865,331.70	2.52
218	301210	金杨精密	3,850,600.00	2.51
219	300054	鼎龙股份	3,850,515.00	2.51
220	300832	新产业	3,825,382.80	2.49
221	600362	江西铜业	3,817,700.00	2.48
222	688120	华海清科	3,815,234.44	2.48
223	001215	千味央厨	3,813,079.00	2.48
224	301607	富特科技	3,808,548.41	2.48
225	300433	蓝思科技	3,799,781.00	2.47
226	300324	旋极信息	3,788,244.00	2.47
227	002371	北方华创	3,788,236.00	2.47
228	688202	美迪西	3,788,136.99	2.47
229	301235	华康洁净	3,763,455.00	2.45
230	002414	高德红外	3,750,895.00	2.44
231	601877	正泰电器	3,728,473.00	2.43
232	605117	德业股份	3,682,959.40	2.40
233	000895	双汇发展	3,667,094.00	2.39
234	688428	诺诚健华	3,633,422.31	2.36
235	600233	圆通速递	3,628,363.00	2.36
236	600028	中国石化	3,601,071.00	2.34
237	601012	隆基绿能	3,595,710.00	2.34
238	002206	海利得	3,573,778.00	2.33
239	600515	海南机场	3,548,421.00	2.31
240	300652	雷迪克	3,541,168.00	2.30
241	000157	中联重科	3,533,035.00	2.30
242	601607	上海医药	3,526,102.00	2.29
243	600895	张江高科	3,508,967.00	2.28
244	600177	雅戈尔	3,489,227.00	2.27
245	600966	博汇纸业	3,485,993.28	2.27
246	300573	兴齐眼药	3,485,603.80	2.27
247	002250	联化科技	3,478,610.00	2.26
248	000728	国元证券	3,465,721.00	2.26
249	600559	老白干酒	3,451,242.00	2.25
250	002550	千红制药	3,448,129.00	2.24
251	688244	永信至诚	3,448,064.28	2.24
252	300345	华民股份	3,416,844.00	2.22
253	301397	溯联股份	3,415,510.00	2.22
254	000959	首钢股份	3,406,416.00	2.22
255	003816	中国广核	3,398,977.00	2.21
256	688716	中研股份	3,366,984.85	2.19
257	300049	福瑞医科	3,358,484.00	2.19
258	300074	华平股份	3,353,786.00	2.18

259	300648	星云股份	3,352,338.00	2.18
260	000039	中集集团	3,314,023.00	2.16
261	688458	美芯晟	3,302,261.65	2.15
262	600884	杉杉股份	3,299,954.00	2.15
263	001872	招商港口	3,299,145.00	2.15
264	300698	万马科技	3,291,747.00	2.14
265	000069	华侨城 A	3,280,208.00	2.13
266	301022	海泰科	3,278,675.00	2.13
267	688618	三旺通信	3,262,450.58	2.12
268	002193	如意集团	3,241,943.00	2.11
269	300181	佐力药业	3,231,745.00	2.10
270	688728	格科微	3,220,638.82	2.10
271	000921	海信家电	3,214,743.00	2.09
272	002245	蔚蓝锂芯	3,209,192.00	2.09
273	603167	渤海轮渡	3,201,175.00	2.08
274	300153	科泰电源	3,196,979.00	2.08
275	301379	天山电子	3,190,188.00	2.08
276	002340	格林美	3,181,185.00	2.07
277	300578	会畅科技	3,167,514.00	2.06
278	688006	杭可科技	3,166,073.47	2.06
279	002393	力生制药	3,164,651.00	2.06
280	688316	青云科技	3,151,676.15	2.05
281	603090	宏盛股份	3,147,968.00	2.05
282	000063	中兴通讯	3,135,238.00	2.04
283	002166	莱茵生物	3,132,629.00	2.04
284	002281	光迅科技	3,127,749.00	2.04
285	300866	安克创新	3,121,035.00	2.03
286	300001	特锐德	3,105,610.00	2.02
287	603358	华达科技	3,095,633.20	2.01
288	002930	宏川智慧	3,094,033.00	2.01
289	001979	招商蛇口	3,088,620.00	2.01
290	600995	南网储能	3,077,515.00	2.00
291	301408	华人健康	3,076,663.00	2.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	33,377,724.00	21.72
2	600519	贵州茅台	25,224,922.05	16.42
3	300476	胜宏科技	25,018,433.72	16.28
4	300274	阳光电源	24,462,273.36	15.92

5	601899	紫金矿业	23,992,016.00	15.61
6	002594	比亚迪	23,326,014.00	15.18
7	300308	中际旭创	22,155,653.81	14.42
8	600036	招商银行	19,848,033.00	12.92
9	601600	中国铝业	16,930,192.00	11.02
10	601318	中国平安	16,816,503.52	10.94
11	600276	恒瑞医药	16,617,215.43	10.81
12	300502	新易盛	15,619,913.80	10.17
13	000001	平安银行	15,553,001.35	10.12
14	603993	洛阳钼业	15,103,387.00	9.83
15	000100	TCL科技	15,088,665.00	9.82
16	002050	三花智控	14,990,001.00	9.76
17	603259	药明康德	14,640,564.00	9.53
18	000333	美的集团	14,478,389.98	9.42
19	000725	京东方A	14,159,122.00	9.21
20	601857	中国石油	13,886,191.97	9.04
21	300059	东方财富	13,741,119.00	8.94
22	603986	兆易创新	12,858,061.00	8.37
23	600031	三一重工	12,769,201.00	8.31
24	002384	东山精密	12,438,494.00	8.09
25	600919	江苏银行	12,360,538.00	8.04
26	601985	中国核电	11,996,643.00	7.81
27	601919	中远海控	11,894,553.00	7.74
28	603799	华友钴业	11,748,816.00	7.65
29	688981	中芯国际	11,729,499.97	7.63
30	600418	江淮汽车	11,422,193.00	7.43
31	300014	亿纬锂能	11,402,586.14	7.42
32	600690	海尔智家	11,390,431.00	7.41
33	002027	分众传媒	11,328,713.73	7.37
34	002001	新和成	11,272,944.00	7.34
35	002230	科大讯飞	11,155,311.00	7.26
36	000858	五粮液	11,126,436.00	7.24
37	688008	澜起科技	10,956,846.31	7.13
38	603288	海天味业	10,913,474.36	7.10
39	600030	中信证券	10,607,248.00	6.90
40	600547	山东黄金	10,598,129.36	6.90
41	688012	中微公司	10,570,840.23	6.88
42	600050	中国联通	10,352,866.00	6.74
43	601628	中国人寿	10,307,949.00	6.71
44	600150	中国船舶	10,201,749.00	6.64
45	603019	中科曙光	10,104,742.00	6.58
46	600893	航发动力	10,084,396.00	6.56
47	688655	迅捷兴	10,063,630.60	6.55

48	600009	上海机场	10,041,488.00	6.53
49	300033	同花顺	9,754,680.00	6.35
50	000425	徐工机械	9,624,033.00	6.26
51	601328	交通银行	9,613,827.00	6.26
52	002463	沪电股份	9,600,790.40	6.25
53	000651	格力电器	9,592,891.00	6.24
54	601398	工商银行	9,589,001.00	6.24
55	002625	光启技术	9,458,992.00	6.16
56	601319	中国人保	9,383,079.00	6.11
57	002415	海康威视	9,370,840.00	6.10
58	603501	豪威集团	9,024,596.00	5.87
59	601288	农业银行	9,014,575.00	5.87
60	688235	百济神州	8,672,713.06	5.64
61	300347	泰格医药	8,497,184.00	5.53
62	300015	爱尔眼科	8,488,292.18	5.52
63	688114	华大智造	8,361,699.13	5.44
64	000975	山金国际	8,341,961.00	5.43
65	601668	中国建筑	8,325,300.00	5.42
66	300760	迈瑞医疗	8,301,616.00	5.40
67	002558	巨人网络	8,276,627.00	5.39
68	002648	卫星化学	8,257,344.76	5.37
69	600018	上港集团	8,254,429.00	5.37
70	002074	国轩高科	8,194,052.00	5.33
71	688223	晶科能源	8,133,557.82	5.29
72	600905	三峡能源	8,073,120.00	5.25
73	600482	中国动力	8,021,991.00	5.22
74	600941	中国移动	8,008,774.00	5.21
75	002008	大族激光	7,960,993.00	5.18
76	600015	华夏银行	7,959,954.00	5.18
77	601818	光大银行	7,734,462.00	5.03
78	688166	博瑞医药	7,653,281.26	4.98
79	600489	中金黄金	7,574,541.53	4.93
80	301358	湖南裕能	7,456,018.00	4.85
81	601127	赛力斯	7,416,360.00	4.83
82	601229	上海银行	7,345,360.00	4.78
83	002252	上海莱士	7,343,114.00	4.78
84	600415	小商品城	7,222,352.00	4.70
85	002180	纳思达	7,177,250.00	4.67
86	300088	长信科技	7,078,823.00	4.61
87	601088	中国神华	7,065,502.00	4.60
88	600372	中航机载	7,063,382.44	4.60
89	600406	国电南瑞	7,050,979.00	4.59
90	601633	长城汽车	6,776,050.00	4.41

91	000625	长安汽车	6,742,603.00	4.39
92	002916	深南电路	6,707,188.00	4.36
93	000807	云铝股份	6,689,848.00	4.35
94	300628	亿联网络	6,535,371.00	4.25
95	002007	华兰生物	6,532,195.00	4.25
96	688171	纬德信息	6,516,341.10	4.24
97	600166	福田汽车	6,477,091.00	4.22
98	601166	兴业银行	6,428,165.00	4.18
99	688256	寒武纪	6,377,255.71	4.15
100	300255	常山药业	6,277,523.80	4.09
101	002475	立讯精密	6,258,615.00	4.07
102	600460	士兰微	6,225,565.00	4.05
103	600795	国电电力	6,159,997.00	4.01
104	601800	中国交建	6,120,175.00	3.98
105	300395	菲利华	6,114,263.00	3.98
106	300037	新宙邦	6,020,131.00	3.92
107	300999	金龙鱼	5,983,639.96	3.89
108	688220	翱捷科技	5,954,130.15	3.87
109	601825	沪农商行	5,932,276.00	3.86
110	600600	青岛啤酒	5,901,177.00	3.84
111	600887	伊利股份	5,894,497.00	3.84
112	603688	石英股份	5,889,046.00	3.83
113	688041	海光信息	5,858,738.35	3.81
114	002460	赣锋锂业	5,828,705.80	3.79
115	600183	生益科技	5,781,165.15	3.76
116	000630	铜陵有色	5,770,035.00	3.76
117	300394	天孚通信	5,743,607.00	3.74
118	601988	中国银行	5,743,540.00	3.74
119	302132	中航成飞	5,724,885.00	3.73
120	301365	矩阵股份	5,698,979.00	3.71
121	600988	赤峰黄金	5,690,414.00	3.70
122	601766	中国中车	5,684,069.10	3.70
123	600111	北方稀土	5,671,999.00	3.69
124	601225	陕西煤业	5,666,643.00	3.69
125	002920	德赛西威	5,665,645.00	3.69
126	600584	长电科技	5,663,036.99	3.69
127	300390	天华新能	5,558,808.82	3.62
128	000792	盐湖股份	5,543,081.00	3.61
129	002049	紫光国微	5,534,790.00	3.60
130	603380	易德龙	5,521,854.00	3.59
131	600771	广誉远	5,441,307.13	3.54
132	300498	温氏股份	5,435,656.00	3.54
133	600660	福耀玻璃	5,425,850.00	3.53

134	601216	君正集团	5,357,859.00	3.49
135	002156	通富微电	5,331,294.00	3.47
136	600938	中国海油	5,303,078.00	3.45
137	601669	中国电建	5,297,594.00	3.45
138	300408	三环集团	5,294,479.00	3.45
139	002407	多氟多	5,292,502.80	3.44
140	002714	牧原股份	5,287,876.00	3.44
141	000988	华工科技	5,262,894.00	3.43
142	600298	安琪酵母	5,229,146.00	3.40
143	000686	东北证券	5,183,668.00	3.37
144	601083	锦江航运	5,145,382.33	3.35
145	300558	贝达药业	5,102,676.50	3.32
146	002244	滨江集团	5,074,602.00	3.30
147	002532	天山铝业	5,069,874.00	3.30
148	601658	邮储银行	5,034,753.00	3.28
149	605499	东鹏饮料	4,981,741.10	3.24
150	688111	金山办公	4,938,052.77	3.21
151	300251	光线传媒	4,915,055.00	3.20
152	601888	中国中免	4,888,576.00	3.18
153	600529	山东药玻	4,887,768.00	3.18
154	002352	顺丰控股	4,855,896.00	3.16
155	300418	昆仑万维	4,818,469.00	3.14
156	688208	道通科技	4,804,178.14	3.13
157	000933	神火股份	4,802,134.00	3.13
158	002028	思源电气	4,796,876.00	3.12
159	688737	中自科技	4,778,463.33	3.11
160	601728	中国电信	4,759,381.00	3.10
161	688180	君实生物	4,718,167.70	3.07
162	600378	昊华科技	4,696,155.00	3.06
163	603529	爱玛科技	4,692,747.00	3.05
164	601808	中海油服	4,664,965.76	3.04
165	600570	恒生电子	4,556,407.00	2.97
166	001203	大中矿业	4,556,076.00	2.97
167	000729	燕京啤酒	4,548,404.00	2.96
168	301345	涛涛车业	4,516,892.00	2.94
169	600048	保利发展	4,491,024.00	2.92
170	000977	浪潮信息	4,462,265.00	2.90
171	601006	大秦铁路	4,421,114.00	2.88
172	000408	藏格矿业	4,407,066.00	2.87
173	000877	天山股份	4,403,891.00	2.87
174	002105	信隆健康	4,401,448.00	2.86
175	301259	艾布鲁	4,393,787.00	2.86
176	000009	中国宝安	4,374,722.00	2.85

177	688347	华虹公司	4,368,364.36	2.84
178	603806	福斯特	4,365,523.00	2.84
179	600332	白云山	4,333,796.99	2.82
180	300759	康龙化成	4,321,448.00	2.81
181	300946	恒而达	4,303,070.70	2.80
182	300420	五洋自控	4,292,872.00	2.79
183	601989	中国重工	4,286,099.00	2.79
184	600011	华能国际	4,272,061.00	2.78
185	002155	湖南黄金	4,270,257.00	2.78
186	002422	科伦药业	4,255,394.00	2.77
187	688047	龙芯中科	4,247,765.76	2.76
188	688158	优刻得	4,244,393.50	2.76
189	601138	工业富联	4,238,539.00	2.76
190	600066	宇通客车	4,238,221.41	2.76
191	002850	科达利	4,222,690.00	2.75
192	000538	云南白药	4,163,765.40	2.71
193	688608	恒玄科技	4,159,694.36	2.71
194	600674	川投能源	4,145,042.00	2.70
195	600745	闻泰科技	4,101,191.00	2.67
196	600335	国机汽车	4,043,636.00	2.63
197	300124	汇川技术	4,037,962.42	2.63
198	601211	国泰海通	4,023,963.76	2.62
199	688156	路德科技	4,019,782.38	2.62
200	002206	海利得	4,016,777.30	2.61
201	002432	九安医疗	4,016,727.00	2.61
202	002607	中公教育	4,012,999.00	2.61
203	001215	千味央厨	3,977,317.00	2.59
204	300433	蓝思科技	3,976,860.00	2.59
205	601360	三六零	3,966,214.00	2.58
206	300324	旋极信息	3,948,008.00	2.57
207	688375	国博电子	3,929,775.06	2.56
208	000661	长春高新	3,911,908.00	2.55
209	300054	鼎龙股份	3,878,472.00	2.52
210	300832	新产业	3,871,513.00	2.52
211	300146	汤臣倍健	3,868,494.00	2.52
212	600325	华发股份	3,867,737.00	2.52
213	000031	大悦城	3,856,715.00	2.51
214	601016	节能风电	3,850,705.00	2.51
215	601111	中国国航	3,842,432.00	2.50
216	002371	北方华创	3,829,632.00	2.49
217	002544	普天科技	3,784,648.00	2.46
218	300345	华民股份	3,780,983.00	2.46
219	600019	宝钢股份	3,779,854.00	2.46

220	000063	中兴通讯	3,763,694.00	2.45
221	301607	富特科技	3,761,349.80	2.45
222	002414	高德红外	3,747,180.00	2.44
223	601877	正泰电器	3,745,587.00	2.44
224	300652	雷迪克	3,719,092.30	2.42
225	688202	美迪西	3,691,794.32	2.40
226	600196	复星医药	3,687,347.00	2.40
227	301235	华康洁净	3,653,926.00	2.38
228	300698	万马科技	3,619,979.00	2.36
229	600362	江西铜业	3,611,128.00	2.35
230	600884	杉杉股份	3,558,783.00	2.32
231	002992	宝明科技	3,552,107.00	2.31
232	600966	博汇纸业	3,526,018.00	2.29
233	300136	信维通信	3,519,943.00	2.29
234	600515	海南机场	3,499,876.00	2.28
235	601012	隆基绿能	3,491,468.00	2.27
236	301022	海泰科	3,470,149.00	2.26
237	000157	中联重科	3,468,890.00	2.26
238	600028	中国石化	3,468,047.00	2.26
239	002550	千红制药	3,467,893.00	2.26
240	600233	圆通速递	3,457,333.00	2.25
241	002250	联化科技	3,448,118.00	2.24
242	000728	国元证券	3,447,883.00	2.24
243	600895	张江高科	3,436,245.00	2.24
244	300074	华平股份	3,429,676.00	2.23
245	000568	泸州老窖	3,401,388.05	2.21
246	601607	上海医药	3,385,142.00	2.20
247	300181	佐力药业	3,374,010.00	2.20
248	688303	大全能源	3,373,012.32	2.20
249	688618	三旺通信	3,363,126.98	2.19
250	002281	光迅科技	3,360,176.00	2.19
251	300648	星云股份	3,356,899.00	2.18
252	000959	首钢股份	3,352,207.52	2.18
253	688120	华海清科	3,334,881.90	2.17
254	301118	恒光股份	3,326,734.00	2.17
255	002340	格林美	3,325,423.00	2.16
256	000069	华侨城A	3,304,848.00	2.15
257	603167	渤海轮渡	3,297,181.00	2.15
258	300578	会畅科技	3,277,517.00	2.13
259	300153	科泰电源	3,272,047.00	2.13
260	300573	兴齐眼药	3,271,118.80	2.13
261	688716	中研股份	3,266,674.57	2.13
262	600578	京能电力	3,240,067.00	2.11

263	002193	如意集团	3,239,768.00	2.11
264	600559	老白干酒	3,239,580.00	2.11
265	002938	鹏鼎控股	3,237,977.00	2.11
266	601519	大智慧	3,237,542.00	2.11
267	688458	美芯晟	3,230,506.06	2.10
268	001872	招商港口	3,206,043.00	2.09
269	000895	双汇发展	3,205,661.00	2.09
270	301210	金杨精密	3,195,609.67	2.08
271	301408	华人健康	3,195,310.00	2.08
272	002245	蔚蓝锂芯	3,193,100.00	2.08
273	603565	中谷物流	3,188,207.00	2.07
274	600989	宝丰能源	3,175,561.00	2.07
275	002393	力生制药	3,170,791.40	2.06
276	601187	厦门银行	3,170,437.00	2.06
277	000921	海信家电	3,163,093.00	2.06
278	605117	德业股份	3,153,596.00	2.05
279	300941	创识科技	3,150,551.00	2.05
280	600668	尖峰集团	3,142,048.12	2.04
281	688006	杭可科技	3,138,006.47	2.04
282	300049	福瑞医科	3,127,590.00	2.04
283	002166	莱茵生物	3,124,386.00	2.03
284	603659	璞泰来	3,123,144.00	2.03
285	688728	格科微	3,116,764.64	2.03
286	600995	南网储能	3,102,423.00	2.02
287	603358	华达科技	3,090,472.36	2.01
288	600207	安彩高科	3,086,979.00	2.01
289	688244	永信至诚	3,079,928.48	2.00

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	3,075,954,816.25
卖出股票收入（成交）总额	2,991,257,225.43

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

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局的处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或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	344,280.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,327,088.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,671,368.76

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
鹏扬中证 A500 指数增强 A	1,340	70,761.07	1,928,889.71	2.03%	92,890,946.68	97.97%
鹏扬中证	1,867	14,413.13	-	-	26,909,319.60	100.00%

A500 指数增强 C						
合计	3,207	37,957.33	1,928,889.71	1.58%	119,800,266.28	98.42%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏扬中证 A500 指数增强 A	428,322.96	0.4517%
	鹏扬中证 A500 指数增强 C	66,730.51	0.2480%
	合计	495,053.47	0.4067%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	鹏扬中证 A500 指数增强 A	0~10
	鹏扬中证 A500 指数增强 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏扬中证 A500 指数增强 A	0~10
	鹏扬中证 A500 指数增强 C	0~10
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鹏扬中证 A500 指数增强 A	鹏扬中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 4 日）基金份额总额	1,010,432,667.90	929,788,657.72
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	76,966,133.28	151,540,462.09
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	992,578,964.79	1,054,419,800.21
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	94,819,836.39	26,909,319.60

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：

本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：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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容诚会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 20,000.00 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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未发生受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未发生受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无

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	
中银证券	3	3,909,016,101.50	64.46%	747,280.42	49.13%	-
国新证券	3	1,647,782,680.59	27.17%	676,611.82	44.49%	-
湘财证券	3	507,922,139.16	8.38%	97,027.06	6.38%	-

注：（1）本基金证券经纪机构的选择标准为公司治理良好、财务状况健康、经营行为规范、合规风控能力较强、研究综合实力和交易服务能力较强、在某些行业或领域具有突出专业服务能力、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的券商。

（2）本基金证券经纪机构的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经纪机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经纪机构及基金托管人签订证券经纪服务协议。

（3）本基金实际支付的佣金按证券经纪服务协议约定的费率计算，在进行交易结算时逐笔清算并完成交收。本基金的证券经纪机构湘财证券股份有限公司、国新证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司与本基金管理人不存在关联关系。

（4）本基金于 2025 年 3 月 4 日成立，以上证券经纪机构的交易单元均为本基金本报告期内新增的交易单元。

（5）本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。

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
中银证券	102,570.49	63.58%	736,600,000.00	13.59%	-	-	-	-

国新证券	45,370.22	28.12%	2,622,800,000.00	48.40%	-	-	-	-
湘财证券	13,390.06	8.30%	2,060,100,000.00	38.01%	-	-	-	-

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 A500 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 3 月 5 日
2	鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 3 月 14 日
3	鹏扬基金管理有限公司关于旗下鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 3 月 27 日
4	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 4 月 1 日
5	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在代销渠道开展费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 5 月 27 日
6	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 5 月 30 日
7	鹏扬基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 6 月 6 日
8	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 6 月 12 日
9	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 6 月 12 日
10	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与兴业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	2025 年 6 月 24 日
11	鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 7 月 18 日
12	关于警惕冒用“鹏扬基金”名义进行非法活动的澄清公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 8 月 1 日
13	鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 8 月 30 日
14	鹏扬基金管理有限公司关于公司旗下	证监会指定报刊及网	2025 年 9 月 5 日

	部分基金估值调整情况的公告	站、公司官网	
15	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与红塔证券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	2025 年 9 月 27 日
16	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏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	2025 年 10 月 13 日
17	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通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	2025 年 10 月 17 日
18	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安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	2025 年 10 月 21 日
19	鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 10 月 27 日
20	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 12 月 3 日
21	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售（广州）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	2025 年 12 月 11 日
22	鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 12 月 11 日
23	鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的通知	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 12 月 30 日
24	关于警惕冒用“鹏扬基金”名义进行非法活动的澄清公告	证监会指定报刊及网站、公司官网	2025 年 12 月 31 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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.中国证监会准予鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金注册的文件；

2.《鹏扬中证 A500 指数增强型证券投资基金基金合同》；

3.《鹏扬中证 A500 指数增强型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中国证监会规定媒介上披露的各项公告。

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

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人和/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

2026 年 3 月 30 日