

# 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 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>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <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                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 11        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 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合规守信情况的说明              | 13        |
| 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             | 16        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 18        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 18        |
| 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       | 18        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>19</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 19        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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的真实、准确和完整发表意见      | 19        |
| <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 所有者权益（基金净值）变动表                      | 24        |
| 7.4 报表附注                                | 25        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>52</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 52        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 52        |
| 8.3 期末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       | 53        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 54        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 59        |
| 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      | 59        |
| 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   | 60        |

|                                            |           |
|--------------------------------------------|-----------|
| 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..... | 60        |
| 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.....    | 60        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....            | 60        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 60        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                        | 60        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>                  | <b>62</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                | 62        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....             | 62        |
| 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.....     | 62        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>                 | <b>63</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示.....</b>                    | <b>64</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                     | 64        |
| 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.....      | 64        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 64        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                       | 64        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                | 64        |
| 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.....         | 64        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....               | 64        |
| 11.8 其他重大事件 .....                          | 65        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>            | <b>69</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 .....   | 69        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                  | 69        |
| <b>§ 13 备查文件目录.....</b>                    | <b>70</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                          | 70        |
| 13.2 存放地点.....                             | 70        |
| 13.3 查阅方式.....                             | 70        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                     |                 |
|-----------------|---------------------|-----------------|
| 基金名称            | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 鹏扬元合量化股票            |                 |
| 基金主代码           | 007137              |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式              |                 |
| 基金合同生效日         | 2019 年 7 月 9 日      |                 |
| 基金管理人           | 鹏扬基金管理有限公司          |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司        |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 28,681,293.22 份     |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                 |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 鹏扬元合量化股票 A          | 鹏扬元合量化股票 C      |
| 下属分级基金的交易代码:    | 007137              | 007138          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 6,880,883.87 份      | 21,800,409.35 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                         |
|--------|-------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在力求有效控制投资风险的前提下，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。                       |
| 投资策略   | 本基金以量化研究为基础，结合市场现状，用系统化的方式执行投资决策，力求获得多角度、多方位的超额收益。                      |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*90%+中债综合财富（总值）指数收益率*10%                                    |
| 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。本基金可能投资于港股通标的股票，需承担汇率风险及境外市场的风险。 |

### 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                       | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 宋震                               | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 010-68105888                     | (010) 66105799      |
|         | 电子邮箱 | service@pyamc.com                | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-968-6688                     | 95588               |
| 传真      |      | 010-68105966                     | (010) 66105798      |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 120 号 3 层 302 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 办公地址    |      | 北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层       | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码    |      | 100045                           | 100140              |
| 法定代表人   |      | 杨爱斌                              | 陈四清                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                         |
|---------------------|---------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》                                                  |
| 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 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街 1 号东方广场<br>安永大楼 16 层 |
| 注册登记机构 | 鹏扬基金管理有限公司         | 北京西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 16 层       |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2020 年        |               | 2019 年 7 月 9 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|---------------|---------------|------------------------------------------|---------------|
|               | 鹏扬元合量化股票 A    | 鹏扬元合量化股票 C    | 鹏扬元合量化股票 A                               | 鹏扬元合量化股票 C    |
| 本期已实现收益       | 1,970,124.34  | 6,575,708.84  | 826,124.44                               | 1,287,195.11  |
| 本期利润          | 3,411,758.58  | 10,906,213.76 | 1,153,354.35                             | 2,559,558.62  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.4623        | 0.4091        | 0.0320                                   | 0.0391        |
| 本期加权平均净值利润率   | 40.34%        | 36.70%        | 3.15%                                    | 3.88%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 43.82%        | 42.67%        | 6.87%                                    | 4.93%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2020 年末       |               | 2019 年末                                  |               |
| 期末可供分配利润      | 2,261,264.23  | 6,405,585.71  | 428,111.70                               | 1,039,410.67  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.3286        | 0.2938        | 0.0453                                   | 0.0264        |
| 期末基金资产净值      | 10,576,047.81 | 32,634,726.77 | 10,096,994.00                            | 41,373,982.34 |
| 期末基金份额净值      | 1.5370        | 1.4970        | 1.0687                                   | 1.0493        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2020 年末       |               | 2019 年末                                  |               |
| 基金份额累计净值增长率   | 53.70%        | 49.70%        | 6.87%                                    | 4.93%         |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏扬元合量化股票 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      | 26.68%   | 1.22%       | 12.33%     | 0.89%         | 14.35% | 0.33% |
| 过去六个月      | 39.70%   | 1.36%       | 22.58%     | 1.21%         | 17.12% | 0.15% |
| 过去一年       | 43.82%   | 1.39%       | 24.85%     | 1.29%         | 18.97% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 53.70%   | 1.19%       | 33.86%     | 1.13%         | 19.84% | 0.06% |

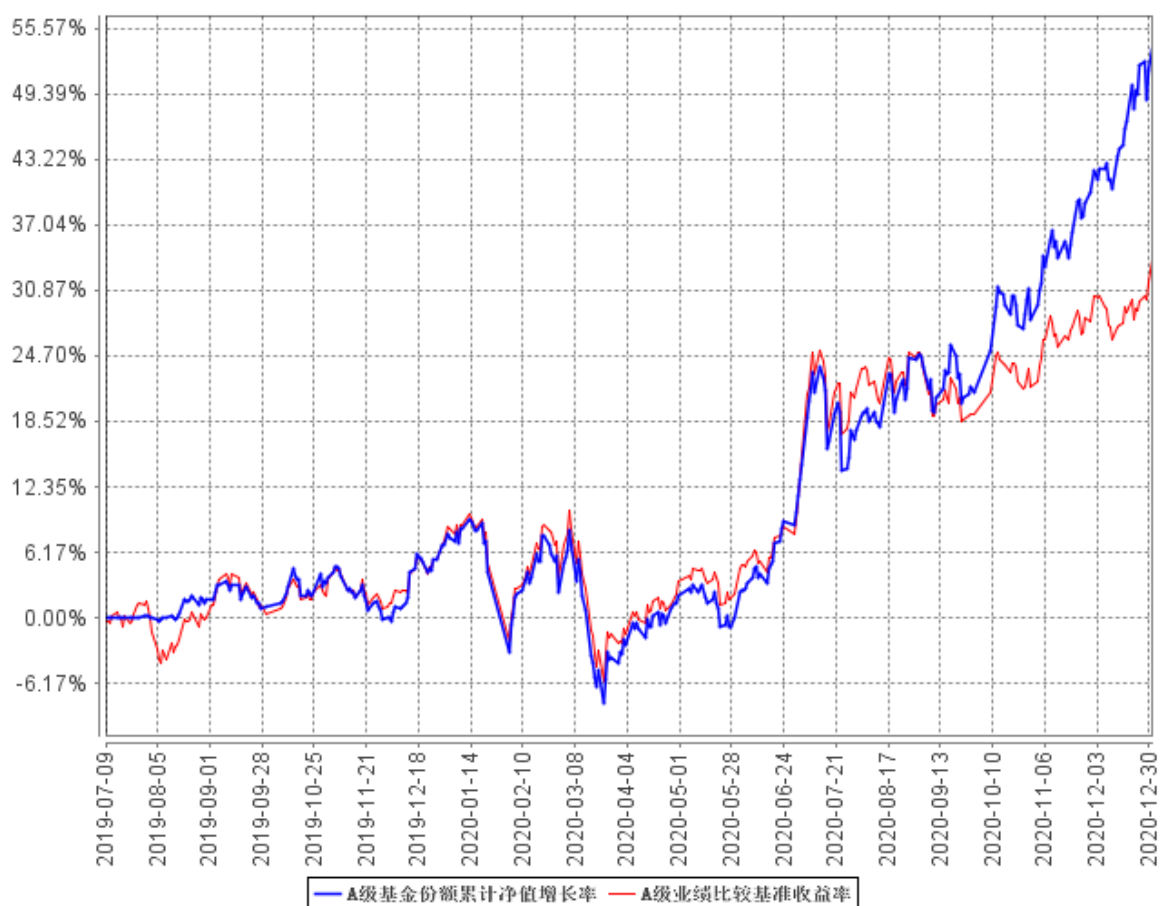
鹏扬元合量化股票 C

| 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 | 26.43%   | 1.22%       | 12.33%     | 0.89%         | 14.10% | 0.33% |

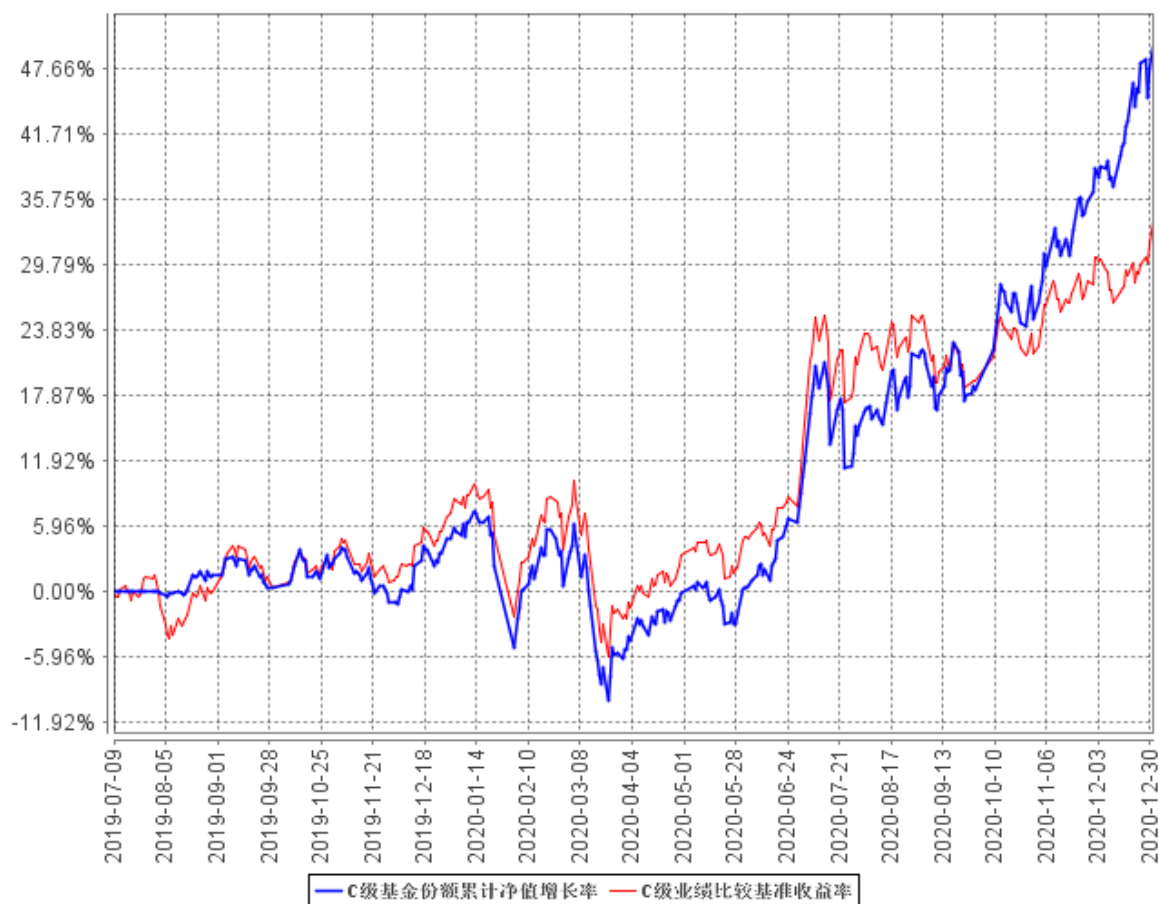
|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月      | 39.14% | 1.35% | 22.58% | 1.21% | 16.56% | 0.14% |
| 过去一年       | 42.67% | 1.39% | 24.85% | 1.29% | 17.82% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 49.70% | 1.19% | 33.86% | 1.13% | 15.84% | 0.06% |

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



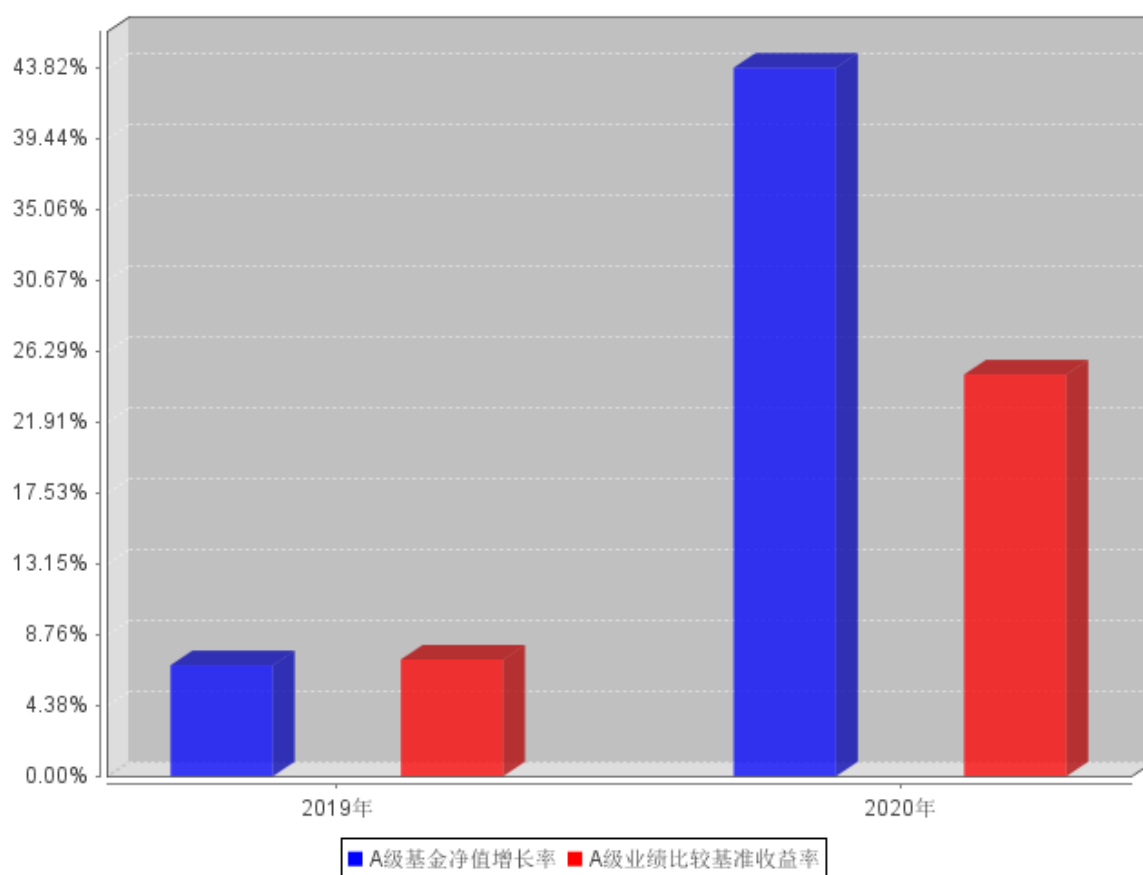
注：（1）上图基金净值表现及业绩比较基准截止日期为 2020 年 12 月 31 日。

（2）本基金合同于 2019 年 7 月 9 日生效。

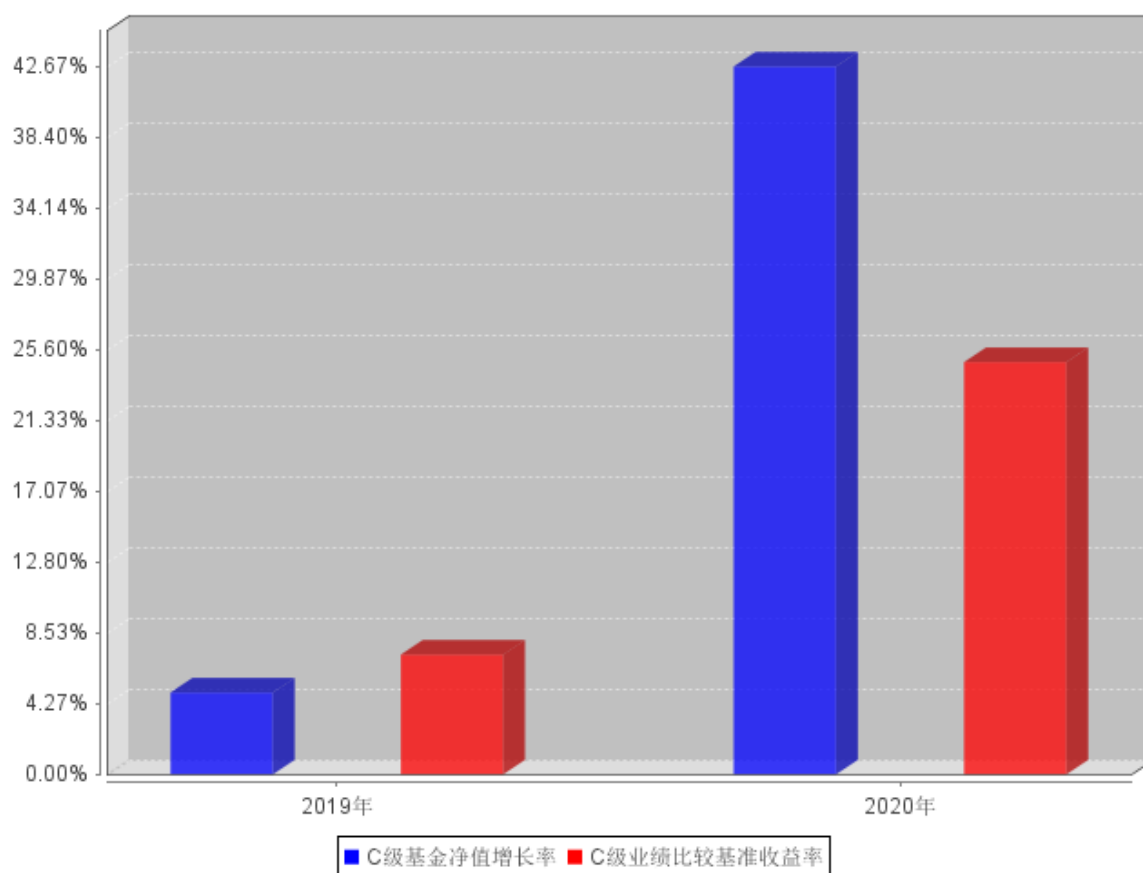
（3）按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分“二、投资范围，四、投资限制”的有关规定。

### 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

#### A级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



C级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



注：（1）本基金基金合同生效日为 2019 年 7 月 9 日。

（2）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基金管理公司，注册地在上海，主要办公地在北京，在北京、上海、深圳设有分公司。

鹏扬基金秉持客户利益第一的价值观，沿着“固定收益+”的产品发展规划路径并以此为特色，协同发展主动债券、主动股票、多资产、主动量化、指数增强五大核心策略。公司的长远目标是成为在中国资本市场上有影响力的、能持续为客户创造价值的专业化资产管理公司。

鹏扬基金建立了行业领先的投研体系，不断强化投研能力，汇聚海内外优秀人才，核心投资人员均具有 10 年以上优秀头部金融机构工作经历，为客户提供“全天候”的资产管理解决方案。同时，鹏扬基金注重风险管理，从文化上树立全员风险防范意识；从制度上实现风险管理在投前、投中、投后的全流程覆盖；从能力建设上持续提升宏观研究、信用研究、衍生品对冲的三大避险能力；从结果上检验风险管理成效，杜绝风险事件的发生。根据海通证券研究所金融产品研究中心基金业绩评价报告，截至 2020 年 12 月 31 日鹏扬基金非货币公募基金资产管理规模为 648 亿元，在 2020 年基金分类排名中，鹏扬基金固定收益投资业绩位居全市场前 1/3、权益投资业绩排名行业 2/136。

#### 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            |        |                                                                                                                                                                                                                      |
| JIANG<br>SHAOKUN | 数量投资<br>部量化投<br>资总监兼<br>衍生品策<br>略总监、<br>本基金基<br>金经理 | 2019 年 7 月 9<br>日 | 2020 年 7 月 20 日 | 20     | 美国哥伦比亚大学统计学硕士，美国伦斯勒理工学院计算机硕士。曾任投资银行 Jefferies & Co. 对冲基金 Millburn Ridgefield Corp 以及 Traxis Partner；路博迈集团（Neuberger Berman Group）及其前身雷曼兄弟资产管理部（Lehman Brothers Asset Management）量化投资部资深副总裁/全球宏观基金经理；对冲基金威禧资产管理公司美国总部 |

|     |                 |                |   |    |                                                                                                                                                                                                        |
|-----|-----------------|----------------|---|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                 |                |   |    | <p>量化投资总监/全球宏观投资经理；前海开源基金管理有限公司量化投资部、FOF 投资部总监；前海开源海外关联企业香港第一前海金融有限公司任董事总经理/联席投资总监，4、9 号牌照责任官（Responsible Officer）；2018 年 3 月加入鹏扬基金管理有限公司。2019 年 7 月 9 日至 2020 年 7 月 20 日任鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金经理。</p> |
| 施红俊 | 数量投资部总经理兼指数投资总监 | 2020 年 6 月 9 日 | - | 15 | <p>同济大学管理学博士，曾任大公国际资信评估有限公司上海分公司中小企业评级部部门经理，中证指数有限公司研究员、固定收益主管、研究开发部副总监。现任鹏扬基金管理有限公司数量投资部总经理兼指数投资总监。2019 年 8 月 29 日至今任鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金基金经理；2020 年 6 月 9 日至今任鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金经理。</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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年，受到突发的新冠疫情冲击及后续持久影响，全球经济发展节奏被打乱并陷入衰退，但与此同时，很多行业的演变进程得到了加速。随着疫情得到控制，经济发展上挑战与机遇并存，经济增长上复苏是主题。中国成为全球唯一实现经济正增长的主要经济体，欧美国家 GDP 仍处负增长状态。中国逆周期部门已实现强劲增长，但顺周期的消费与制造业投资还处于复苏途中。需求和供给替代推动出口成为 2020 年经济的主要支撑。2020 年中国全年出口增长 3.6%，成为少数出口正增长的国家，占全球的出口份额创下历史新高。受益于疫情的行业如防疫物资、宅经济相关家具家电等、消费电子为代表的耐用消费品等出口强劲。而疫情“受损”板块，如成品油、交通运输、休闲旅游、线下消费、煤炭钢铁等，则显著弱于以往。通胀方面，CPI 同比随着猪肉价格平稳回落，PPI 先下后上，主要受上游原材料及能源化工品价格影响。央行报告认为物价涨幅总体延续下行走势，不存在长期通胀或通缩的基础。政策方面，为应对疫情冲击，全球央行都通过各种货币政策或综合手段扩表刺激经济，以确保信用供给通畅，同时财政政策也更加积极。国内流动性方面，上半年央行连续降准并结合公开市场操作保持流动性合理充裕，货币政策着重在于用好直达实体的结构性宽信用政策，同时打击各种套利行为；下半年随着经济复苏，央行通过灵活适度的公开市场操作逐步实现了货币政策的正常化，社融增速在 11 月见顶回落。

2020 年，资本市场交出了满意的答卷，A 股以 27.21%（沪深 300）的涨幅继续领跑全球大类资产。从结构来看，成长风格明显更加强势：代表大盘价值风格的上证 50 和沪深 300 分别上涨 18.85%和 27.21%，代表中小盘成长风格的创业板指和中小板指分别上涨 64.96%和 43.91%。从板块表现来看，疫情期间受国内疫情影响弱的科技股、必选消费板块表现较强，年中之后经济复苏推动周期股回升。从

行业表现来看，受益于疫情防控的医药、偏防御的食品饮料率先复苏，受益于免税政策的休闲服务、受益于政策支持及行业景气度的新能源、国防军工、汽车等涨幅居前，而受到“三条红线”政策影响的房地产、受制于疫情和经济下行预期的银行以及景气度走弱的通信、建筑等跌幅居前。因子表现方面，价值因子下半年有复苏迹象，盈利、成长因子延续全年趋势震荡上行，估值成长因子收益“剪刀差”显著收敛，而传统量价因子则表现不佳。

操作上，本基金本报告期内以沪深 300 为股票池，运用多维量化模型构建优选股票组合，从多个角度获取超额收益。仓位上，本基金本年度保持了 9 成以上的仓位，从而也获取了市场 beta 收益。行业配置上，相比沪深 300，本基金超配有色、汽车、电气设备、新能源、基础化工，低配地产、电子、计算机、通信。同时，对部分获利较多的个股及时获利了结，避免了后续的大幅回撤。通过仓位、行业配置、波段操作等措施，增强产品收益。2020 年，本基金取得了不错的业绩回报，A 类净值上涨 43.82%，超业绩基准 18.97%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鹏扬元合量化股票 A 基金份额净值为 1.5370 元，本报告期基金份额净值增长率为 43.82%；截至本报告期末鹏扬元合量化股票 C 基金份额净值为 1.4970 元，本报告期基金份额净值增长率为 42.67%；同期业绩比较基准收益率为 24.85%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年，新冠疫情对全球经济的冲击和影响仍在持续，全球疫情防控呈现常态化长期化趋势。但随着新冠疫苗的成功研发和陆续接种，疫情对经济的影响将边际减弱，但对人类生活方式的改变可能会存在一定惯性。拜登上任后采取积极的防疫政策，并计划重返巴黎协定、重视清洁能源，对内强调公平，如对公司与富人加税、加强科技与金融监管、降低药品价格；对外反对贸易战，加强与盟友的关系。若美国经济数据持续回升，美元指数则存在阶段性走强可能。

2021 年是“十四五”规划的开局之年，“十四五”规划的主题是推动高质量发展。宏观政策要保持连续性、稳定性、可持续性，不急转弯；积极的财政政策要提质增效、更可持续；稳健的货币政策要灵活精准、合理适度，保持货币供应量和社会融资规模增速同名义经济增速基本匹配，保持宏观杠杆率基本稳定，处理好恢复经济和防范风险关系。

经济增长方面，PMI 指标已经连续 10 个月在 50 以上，内外需均好于预期，供给和需求也同步改善，显示经济复苏情况较好。工业企业收入在逐月回升，企业库存正常去化，制造业整体利润或进一步改善。海外经济随着疫情逐渐控制住复苏是大方向，对我国产业链也会有正面效应，我国经济也仍会渐进复苏逐步回到潜在产出水平。

通货膨胀方面，通胀条件目前对资产价格尚不构成制约，2021 年的通胀程度将取决于商品趋势。

流动性方面，社融增速水平上仍处过去两年来较高水平，企业贷款结构较好，对实体经济的流动性仍有较好支撑；但趋势确定性下行，2021 年预计在 11%左右。

展望 2021 年，我们要管理好对 A 股市场的收益预期，市场更多是结构性机会，赚钱要靠基本面和盈利趋势，继续赚估值扩张的钱可能很难了。结构上看，首先还是要聚焦核心资产。原因包括：第一，核心资产确定性最强，特别是在流动性收缩的背景之下；第二，经过疫情考验，各行业的龙头公司的优势更加明显；第三，随着普通投资者参与基金的比例提升和基金管理人的集中度越来越高，资金层面也支持核心资产跑出超额收益。不过，对于估值太高的核心资产也要适度止盈，不能不切实际地指望它永远涨，市场波动加大的背景下适度波段操作或许是更好的选择。市场风格方面，随着经济持续复苏和超额流动性边际收缩，2020 年大幅落后的价值股预计也将逐步回升，去年明显分化的市场风格特征或有所修复。行业板块上看好低估值及基本面改善的银行，受益于利率上行的保险，长期景气赛道新能源车、光伏，景气度较为确定的国防军工，以及受益于全球复苏供给端的制造业龙头板块。

#### 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”等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手段，监督投资管理人员的个人行为，防范出现违反监管法规或公司规章的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，依据最新监管要求和公司业务开展情况，梳理相关业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。本基金管理人设立估值委员会（成员包括公司分管领导以及投资研究部、监察稽核部、交易管理部、基金运营部等部门负责人及相关业务骨干，估值委员会成员中不包括基金经理）。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定，本基金管理人已向中国证监会报告并递交解决方案，本基金将继续运作。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

本报告期内，本基金托管人在对鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金的管理人——鹏扬基金管理有限公司在鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对鹏扬基金管理有限公司编制和披露的鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                            |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                      |
| 审计报告编号     | 安永华明（2021）审字第 61290365_A18 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         | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 审计意见            | <p>我们审计了鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。</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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>                                                                                                         |
| 其他信息            | <p>鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估鹏扬元合量化大盘优选股票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，除非管理层计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>                                            |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <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>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对鹏扬元合量化大盘优选股票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元合量化大盘优选股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称       | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 注册会计师的姓名        | 王珊珊 王海彦                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 会计师事务所的地址       | 中国 北京                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 审计报告日期          | 2021 年 3 月 26 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 329,241.10                      | 247,083.22                       |
| 结算备付金           |            | 322,883.43                      | 468,229.91                       |
| 存出保证金           |            | 17,337.06                       | 88,025.10                        |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 42,757,719.97                   | 51,176,358.60                    |
| 其中：股票投资         |            | 40,490,621.57                   | 47,851,608.60                    |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 2,267,098.40                    | 3,324,750.00                     |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 309,518.00                      | 102,232.83                       |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 37,465.33                       | 49,693.83                        |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 7,630.31                        | 10.00                            |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 43,781,795.20                   | 52,131,633.49                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 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       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 318,143.00                      | 298,502.66                       |
| 应付管理人报酬         |            | 27,618.96                       | 63,814.91                        |
| 应付托管费           |            | 8,630.93                        | 10,635.83                        |
| 应付销售服务费         |            | 21,079.78                       | 20,046.32                        |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 95,547.79                       | 177,219.71                       |
| 应交税费            |            | 0.16                            | -                                |
| 应付利息            |            | -                               | -                                |

|               |          |               |               |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利润          |          | -             | -             |
| 递延所得税负债       |          | -             | -             |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 100,000.00    | 90,437.72     |
| 负债合计          |          | 571,020.62    | 660,657.15    |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 28,681,293.22 | 48,877,017.87 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 14,529,481.36 | 2,593,958.47  |
| 所有者权益合计       |          | 43,210,774.58 | 51,470,976.34 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 43,781,795.20 | 52,131,633.49 |

注：（1）报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 28,681,293.22 份，其中鹏扬元合量化大盘优选股票 A 基金份额净值 1.5370 元，份额总额 6,880,883.87 份；鹏扬元合量化大盘优选股票 C 基金份额净值 1.4970 元，份额总额 21,800,409.35 份。

（2）本基金合同于 2019 年 7 月 9 日生效，上年度可比期间自 2019 年 7 月 9 日至 2019 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合<br>同生效日)至 2019 年 12<br>月 31 日 |
|-------------------|------------|-------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>       |            | 15,874,512.55                             | 5,663,232.90                                                |
| 1.利息收入            |            | 81,464.03                                 | 693,927.49                                                  |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.11   | 6,318.64                                  | 44,459.80                                                   |
| 债券利息收入            |            | 67,335.32                                 | 485,685.79                                                  |
| 资产支持证券利息收入        |            | -                                         | -                                                           |
| 买入返售金融资产收入        |            | 7,810.07                                  | 163,781.90                                                  |
| 证券出借利息收入          |            | -                                         | -                                                           |
| 其他利息收入            |            | -                                         | -                                                           |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）  |            | 10,015,371.18                             | 3,122,616.01                                                |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.12   | 9,370,857.80                              | 2,894,427.69                                                |
| 基金投资收益            |            | -                                         | -                                                           |
| 债券投资收益            | 7.4.7.13   | 8,539.54                                  | 134,404.42                                                  |
| 资产支持证券投资收益        | 7.4.7.13.3 | -                                         | -                                                           |
| 贵金属投资收益           | 7.4.7.14   | -                                         | -                                                           |
| 衍生工具收益            | 7.4.7.15   | -                                         | -                                                           |
| 股利收益              | 7.4.7.16   | 635,973.84                                | 93,783.90                                                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-” | 7.4.7.17   | 5,772,139.16                              | 1,599,593.42                                                |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 号填列)                       |            |               |              |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -             | -            |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.18   | 5,538.18      | 247,095.98   |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 1,556,540.21  | 1,950,319.93 |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 457,237.55    | 718,056.81   |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 95,516.39     | 119,676.11   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 238,178.06    | 245,658.57   |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 645,021.38    | 769,914.99   |
| 5. 利息支出                    |            | 23.88         | 65.53        |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 23.88         | 65.53        |
| 6. 税金及附加                   |            | 0.14          | 3.71         |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 120,562.81    | 96,944.21    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 14,317,972.34 | 3,712,912.97 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 14,317,972.34 | 3,712,912.97 |

注：本基金合同于 2019 年 7 月 9 日生效，上年度可比期间自 2019 年 7 月 9 日至 2019 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |               |                |
|----------------------------------------|----------------------------------------|---------------|----------------|
|                                        | 实收基金                                   | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 48,877,017.87                          | 2,593,958.47  | 51,470,976.34  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                      | 14,317,972.34 | 14,317,972.34  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -20,195,724.65                         | -2,382,449.45 | -22,578,174.10 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 14,480,804.61                          | 1,328,177.77  | 15,808,982.38  |
| 2. 基金赎回款                               | -34,676,529.26                         | -3,710,627.22 | -38,387,156.48 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                      | -             | -              |

|                                        |                                                      |               |                 |
|----------------------------------------|------------------------------------------------------|---------------|-----------------|
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 28,681,293.22                                        | 14,529,481.36 | 43,210,774.58   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |               |                 |
|                                        | 实收基金                                                 | 未分配利润         | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 212,886,370.27                                       | -             | 212,886,370.27  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                    | 3,712,912.97  | 3,712,912.97    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -164,009,352.40                                      | -1,118,954.50 | -165,128,306.90 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 53,754,356.49                                        | 1,804,965.28  | 55,559,321.77   |
| 2. 基金赎回款                               | -217,763,708.89                                      | -2,923,919.78 | -220,687,628.67 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                                    | -             | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 48,877,017.87                                        | 2,593,958.47  | 51,470,976.34   |

注：本基金合同于 2019 年 7 月 9 日生效，上年度可比期间自 2019 年 7 月 9 日至 2019 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：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>杨爱斌</u> | <u>崔雁巍</u> | <u>韩欢</u> |
| 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

鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]335 号《关于准予鹏扬元合量化大盘优选股票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于 2019 年 6 月 4 日至 2019 年 7 月 5 日向社会公开募集，首次募集的有效净认购金额为人民币 212,838,113.10 元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 48,257.17 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2019）验字第 61290365\_A10 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2019 年 7 月 9 日生效，首次设立募集规模为 212,886,370.27 份基金份额，其中认购资金利息折合 48,257.17 份基金份额，本基金为

契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为鹏扬基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围 为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、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、公开发行的次级债券、政府支持债券、可转债、可交换债、可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（包括权证、股指期货等）、货币市场工具（含同业存单）、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。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不得超过本基金所投资股票资产的 50%），投资于本基金界定的大盘股票的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一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、存出保证金和应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1、金融资产的分类

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

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

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

#### 2、金融负债的分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

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

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

#### (2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

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

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

#### (4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较

小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

金额与其成本的差额入账；

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

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

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

#### 7.4.4.12 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入账。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

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

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

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市

场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

#### 7.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 329,241.10              | 247,083.22               |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | -                       | -                        |
| 存款期限 3 个月以上    | -                       | -                        |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计：            | 329,241.10              | 247,083.22               |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 |               |              |
|---------------|-------|-------------------------|---------------|--------------|
|               |       | 成本                      | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 33,116,477.41           | 40,490,621.57 | 7,374,144.16 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                       | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 2,269,509.98            | 2,267,098.40  | -2,411.58    |
|               | 银行间市场 | -                       | -             | -            |
|               | 合计    | 2,269,509.98            | 2,267,098.40  | -2,411.58    |
| 资产支持证券        |       | -                       | -             | -            |
| 基金            |       | -                       | -             | -            |

|               |                          |               |              |
|---------------|--------------------------|---------------|--------------|
| 其他            | -                        | -             | -            |
| 合计            | 35,385,987.39            | 42,757,719.97 | 7,371,732.58 |
| 项目            | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |               |              |
|               | 成本                       | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | 46,253,110.49            | 47,851,608.60 | 1,598,498.11 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                        | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场                    | 3,323,654.69  | 3,324,750.00 |
|               | 银行间市场                    | -             | -            |
|               | 合计                       | 3,323,654.69  | 3,324,750.00 |
| 资产支持证券        | -                        | -             | -            |
| 基金            | -                        | -             | -            |
| 其他            | -                        | -             | -            |
| 合计            | 49,576,765.18            | 51,176,358.60 | 1,599,593.42 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 25.56                   | 1,141.76                 |
| 应收定期存款利息   | -                       | -                        |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 159.63                  | 231.77                   |
| 应收债券利息     | 37,358.60               | 48,276.74                |
| 应收资产支持证券利息 | -                       | -                        |
| 应收买入返售证券利息 | -87.04                  | -                        |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 应收出借证券利息   | -                       | -                        |
| 其他         | 8.58                    | 43.56                    |
| 合计         | 37,465.33               | 49,693.83                |

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 95,547.79               | 177,219.71               |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 合计          | 95,547.79               | 177,219.71               |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | 437.72                   |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 预提费用        | 100,000.00              | 90,000.00                |
| 合计          | 100,000.00              | 90,437.72                |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 鹏扬元合量化股票 A    |                                        |               |
|---------------|----------------------------------------|---------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |               |
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额          |
| 上年度末          | 9,447,628.47                           | 9,447,628.47  |
| 本期申购          | 6,323,704.32                           | 6,323,704.32  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -8,890,448.92                          | -8,890,448.92 |
| 本期末           | 6,880,883.87                           | 6,880,883.87  |

金额单位：人民币元

| 鹏扬元合量化股票 C    |                                        |                |
|---------------|----------------------------------------|----------------|
| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                |
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额           |
| 上年度末          | 39,429,389.40                          | 39,429,389.40  |
| 本期申购          | 8,157,100.29                           | 8,157,100.29   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -25,786,080.34                         | -25,786,080.34 |
| 本期末           | 21,800,409.35                          | 21,800,409.35  |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 鹏扬元合量化股票 A |
|------------|
|------------|

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分        | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|--------------|--------------|
| 上年度末           | 428,111.70   | 221,253.83   | 649,365.53   |
| 本期利润           | 1,970,124.34 | 1,441,634.24 | 3,411,758.58 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -136,971.81  | -228,988.36  | -365,960.17  |
| 其中：基金申购款       | 663,103.42   | -188,750.43  | 474,352.99   |
| 基金赎回款          | -800,075.23  | -40,237.93   | -840,313.16  |
| 本期已分配利润        | -            | -            | -            |
| 本期末            | 2,261,264.23 | 1,433,899.71 | 3,695,163.94 |

单位：人民币元

| 鹏扬元合量化股票 C     |               |              |               |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
| 上年度末           | 1,039,410.67  | 905,182.27   | 1,944,592.94  |
| 本期利润           | 6,575,708.84  | 4,330,504.92 | 10,906,213.76 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,209,533.80 | -806,955.48  | -2,016,489.28 |
| 其中：基金申购款       | 1,183,016.97  | -329,192.19  | 853,824.78    |
| 基金赎回款          | -2,392,550.77 | -477,763.29  | -2,870,314.06 |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | 6,405,585.71  | 4,428,731.71 | 10,834,317.42 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------|--------------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,880.53                               | 36,679.33                                              |
| 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 | 3,821.03                               | 7,320.92                                               |
| 其他        | 617.08                                 | 459.55                                                 |
| 合计        | 6,318.64                               | 44,459.80                                              |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------------------------|--------------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 263,516,319.80                         | 289,587,841.81                                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 254,145,462.00                         | 286,693,414.12                                         |
| 买卖股票差价收入   | 9,370,857.80                           | 2,894,427.69                                           |

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年7月9日(基金合同生效日)至2019年12月31日 |
|-------------------------------|-----------------------------|-------------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 8,539.54                    | 134,404.42                                |
| 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                            | 8,539.54                    | 134,404.42                                |

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年7月9日(基金合同生效日)至2019年12月31日 |
|-------------------------|-----------------------------|-------------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 6,025,095.15                | 133,117,367.77                            |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 5,868,279.71                | 132,710,496.25                            |
| 减：应收利息总额                | 148,275.90                  | 272,467.10                                |
| 买卖债券差价收入                | 8,539.54                    | 134,404.42                                |

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年7月9日(基金合同生效日)至2019年12月31日 |
|---------------|-----------------------------|-------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 635,973.84                  | 93,783.90                                 |
| 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            | 635,973.84                  | 93,783.90                                 |

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合同<br>生效日)至 2019 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 5,772,139.16                              | 1,599,593.42                                             |
| ——股票投资                     | 5,775,646.05                              | 1,598,498.11                                             |
| ——债券投资                     | -3,506.89                                 | 1,095.31                                                 |
| ——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<br>生的预估增值税 | -                                         | -                                                        |
| 合计                         | 5,772,139.16                              | 1,599,593.42                                             |

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合同生<br>效日)至 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 4,032.14                                  | 247,095.98                                               |
| 基金转换费收入 | 1,506.04                                  | -                                                        |
| 其他      | -                                         | -                                                        |
| 合计      | 5,538.18                                  | 247,095.98                                               |

### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合同生<br>效日)至 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 645,021.38                                | 769,914.99                                               |
| 银行间市场交易费用 | -                                         | -                                                        |
| 合计        | 645,021.38                                | 769,914.99                                               |

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合同<br>生效日)至 2019 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 审计费用  | 50,000.00                                 | 40,000.00                                                |
| 信息披露费 | 50,000.00                                 | 50,000.00                                                |

|         |            |           |
|---------|------------|-----------|
| 证券出借违约金 | -          | -         |
| 银行汇划费   | 2,562.81   | 3,544.21  |
| 账户维护费   | 18,000.00  | 3,000.00  |
| 开户费     | -          | 400.00    |
| 合计      | 120,562.81 | 96,944.21 |

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

无。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 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             |
| 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 |
| 上海济通企业管理中心（有限合伙）     | 基金管理人股东             |
| 上海璞识企业管理中心（有限合伙）     | 基金管理人股东             |
| 上海润京企业管理中心（有限合伙）     | 基金管理人股东             |
| 上海泓至企业管理中心（有限合伙）     | 基金管理人股东             |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构        |

注：1. 根据鹏扬基金 2020 年第二次临时股东会会议决议，宏实资本管理有限公司受让杨爱斌持有的鹏扬基金 2.5%的股权。鹏扬基金《公司章程》的有关条款已根据本次股权转让情况进行了相应修改。

上述事项的工商变更登记手续已于 2020 年 9 月 16 日办理完毕。

2. 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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合同生效<br>日)至 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 457,237.55                                | 718,056.81                                               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 46,905.18                                 | 251,562.25                                               |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合同生效<br>日)至 2019 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 95,516.39                                 | 119,676.11                                               |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日<br>当期发生的基金应支付的销售服务费 |            |            |
|--------------------|------------------------------------------------------------|------------|------------|
|                    | 鹏扬元合量化股票 A                                                 | 鹏扬元合量化股票 C | 合计         |
|                    |                                                            |            |            |
| 鹏扬基金               | -                                                          | 206,451.87 | 206,451.87 |
| 工商银行               | -                                                          | 6,178.24   | 6,178.24   |
| 合计                 | -                                                          | 212,630.11 | 212,630.11 |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31<br>日    |            |            |

|      | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |            |            |
|------|------------------|------------|------------|
|      | 鹏扬元合量化股票 A       | 鹏扬元合量化股票 C | 合计         |
| 鹏扬基金 | -                | 70,443.94  | 70,443.94  |
| 工商银行 | -                | 45,346.51  | 45,346.51  |
| 合计   | -                | 115,790.45 | 115,790.45 |

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 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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

##### 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

份额单位：份

| 项目                             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |            |
|--------------------------------|----------------------------------------|------------|
|                                | 鹏扬元合量化股票 A                             | 鹏扬元合量化股票 C |
| 基金合同生效日（2019 年 7 月 9 日）持有的基金份额 | -                                      | -          |
| 报告期初持有的基金份额                    | -                                      | -          |
| 报告期间申购/买入总份额                   | 4,964,750.27                           | -          |
| 报告期间因拆分变动份额                    | -                                      | -          |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                 | -                                      | -          |
| 报告期末持有的基金份额                    | 4,964,750.27                           | -          |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例        | 17.31%                                 | -          |

| 项目               | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日 |            |
|------------------|------------------------------------------------------|------------|
|                  | 鹏扬元合量化股票 A                                           | 鹏扬元合量化股票 C |
| 基金合同生效日（2019 年 7 | -                                                    | -          |

|                         |   |   |
|-------------------------|---|---|
| 月 9 日 ) 持有的基金份额         |   |   |
| 报告期初持有的基金份额             | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额            | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额             | - | - |
| 减: 报告期间赎回/卖出总份额         | - | - |
| 报告期末持有的基金份额             | - | - |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | - | - |

注: 1. 基金管理人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。

2. 对于分级基金, 下属分级份额的比例的分母采用基金总份额。

#### 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

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<br>名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |          | 上年度可比期间<br>2019 年 7 月 9 日(基金合同生效日)至<br>2019 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    |
| 工商银行      | 329,241.10                             | 1,880.53 | 247,083.22                                              | 36,679.33 |

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2020 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<br>代码              | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日         | 可流通<br>日      | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位: 股) | 期末<br>成本总额 | 期末估值<br>总额 | 备注 |
| 605277                | 新亚电子     | 2020 年<br>12 月 25 | 2021<br>年 1 月 | 新股未<br>上市流 | 16.95    | 16.95      | 291           | 4,932.45   | 4,932.45   | -  |

|        |           |                        |                      |                       |       |       |     |          |          |   |
|--------|-----------|------------------------|----------------------|-----------------------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        |           | 日                      | 6 日                  | 通受限                   |       |       |     |          |          |   |
| 003030 | 祖 名<br>股份 | 2020 年<br>12 月 25<br>日 | 2021<br>年 1 月<br>6 日 | 新 股 未<br>上 市 流<br>通受限 | 15.18 | 15.18 | 312 | 4,736.16 | 4,736.16 | - |
| 003031 | 中 瓷<br>电子 | 2020 年<br>12 月 24<br>日 | 2021<br>年 1 月<br>4 日 | 新 股 未<br>上 市 流<br>通受限 | 15.27 | 15.27 | 254 | 3,878.58 | 3,878.58 | - |

| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |          |                        |                       |                   |          |            |              |            |            |    |
|----------------------|----------|------------------------|-----------------------|-------------------|----------|------------|--------------|------------|------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日              | 可流<br>通日              | 流通受<br>限类型        | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位：张) | 期末<br>成本总额 | 期末估值<br>总额 | 备注 |
| 113616               | 韦尔<br>转债 | 2020 年<br>12 月 30<br>日 | 2021<br>年 1 月<br>22 日 | 新债未<br>上市流<br>通受限 | 100.00   | 100.00     | 140          | 14,000.00  | 14,000.00  | -  |

#### 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

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內。

### 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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不超过该证券的 10%。

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 0.00                    | 0.00                     |
| A-1 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 2,290,456.75            | 3,373,026.74             |
| 合计     | 2,290,456.75            | 3,373,026.74             |

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

（2）未评级债券包含期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的地方政府债、短期融资券。

（3）债券投资以全价列示。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

**7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                    | 0.00                     |
| AAA 以下 | 14,000.25               | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 14,000.25               | 0.00                     |

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

（2）未评级债券包含期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的地方政府债。

（3）债券投资以全价列示。

**7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

**7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

**7.4.13.3 流动性风险**

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人根据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<br>2020 年 12 月 31 日 | 1 个月以内     | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计         |
|-------------------------|------------|--------|----------|-------|-------|-----|------------|
| 资产                      |            |        |          |       |       |     |            |
| 银行存款                    | 329,241.10 | -      | -        | -     | -     | -   | 329,241.10 |
| 结算备付金                   | 322,883.43 | -      | -        | -     | -     | -   | 322,883.43 |
| 存出保证金                   | 17,337.06  | -      | -        | -     | -     | -   | 17,337.06  |

|                          |            |              |              |       |           |               |               |
|--------------------------|------------|--------------|--------------|-------|-----------|---------------|---------------|
| 交易性金融资产                  | -          | 2,253,098.40 | -            | -     | 14,000.00 | 40,490,621.57 | 42,757,719.97 |
| 应收证券清算款                  | -          | -            | -            | -     | -         | 309,518.00    | 309,518.00    |
| 应收利息                     | -          | -            | -            | -     | -         | 37,465.33     | 37,465.33     |
| 应收申购款                    | -          | -            | -            | -     | -         | 7,630.31      | 7,630.31      |
| 资产总计                     | 669,461.59 | 2,253,098.40 | -            | -     | 14,000.00 | 40,845,235.21 | 43,781,795.20 |
| 负债                       | -          | -            | -            | -     | -         | -             | -             |
| 应付赎回款                    | -          | -            | -            | -     | -         | 318,143.00    | 318,143.00    |
| 应付管理人报酬                  | -          | -            | -            | -     | -         | 27,618.96     | 27,618.96     |
| 应付托管费                    | -          | -            | -            | -     | -         | 8,630.93      | 8,630.93      |
| 应付销售服务费                  | -          | -            | -            | -     | -         | 21,079.78     | 21,079.78     |
| 应付交易费用                   | -          | -            | -            | -     | -         | 95,547.79     | 95,547.79     |
| 应交税费                     | -          | -            | -            | -     | -         | 0.16          | 0.16          |
| 其他负债                     | -          | -            | -            | -     | -         | 100,000.00    | 100,000.00    |
| 负债总计                     | -          | -            | -            | -     | -         | 571,020.62    | 571,020.62    |
| 利率敏感度缺口                  | 669,461.59 | 2,253,098.40 | -            | -     | 14,000.00 | 40,274,214.59 | 43,210,774.58 |
| 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 | 1 个月以内     | 1-3 个月       | 3 个月-1 年     | 1-5 年 | 5 年以上     | 不计息           | 合计            |
| 资产                       | -          | -            | -            | -     | -         | -             | -             |
| 银行存款                     | 247,083.22 | -            | -            | -     | -         | -             | 247,083.22    |
| 结算备付金                    | 468,229.91 | -            | -            | -     | -         | -             | 468,229.91    |
| 存出保证金                    | 88,025.10  | -            | -            | -     | -         | -             | 88,025.10     |
| 交易性金融资产                  | -          | -            | 3,324,750.00 | -     | -         | 47,851,608.60 | 51,176,358.60 |
| 应收证券清算款                  | -          | -            | -            | -     | -         | 102,232.83    | 102,232.83    |
| 应收利息                     | -          | -            | -            | -     | -         | 49,693.83     | 49,693.83     |
| 应收申购款                    | -          | -            | -            | -     | -         | 10.00         | 10.00         |
| 其他资产                     | -          | -            | -            | -     | -         | -             | -             |
| 资产总计                     | 803,338.23 | -            | 3,324,750.00 | -     | -         | 48,003,545.26 | 52,131,633.49 |
| 负债                       | -          | -            | -            | -     | -         | -             | -             |
| 应付赎回款                    | -          | -            | -            | -     | -         | 298,502.66    | 298,502.66    |
| 应付管理人报酬                  | -          | -            | -            | -     | -         | 63,814.91     | 63,814.91     |
| 应付托管费                    | -          | -            | -            | -     | -         | 10,635.83     | 10,635.83     |
| 应付销售服务费                  | -          | -            | -            | -     | -         | 20,046.32     | 20,046.32     |
| 应付交易费用                   | -          | -            | -            | -     | -         | 177,219.71    | 177,219.71    |
| 其他负债                     | -          | -            | -            | -     | -         | 90,437.72     | 90,437.72     |
| 负债总计                     | -          | -            | -            | -     | -         | 660,657.15    | 660,657.15    |
| 利率敏感度缺口                  | 803,338.23 | -            | 3,324,750.00 | -     | -         | 47,342,888.11 | 51,470,976.34 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

## 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                                              |                             |                        |
|----|--------------------------------------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 |                             |                        |
|    | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变。                             |                             |                        |
|    | 此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。                              |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                                    | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                                              | 本期末（2020 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率上升 25 个基点                                                | -953.22                     | -4,794.84              |
|    | 市场利率下降 25 个基点                                                | 954.03                      | 4,808.70               |

## 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<br>2020 年 12 月 31 日 |               | 上年度末<br>2019 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  | 40,490,621.57           | 93.70         | 47,851,608.60            | 92.97         |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                       | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 2,267,098.40            | 5.25          | 3,324,750.00             | 6.46          |
| 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            | 42,757,719.97           | 98.95         | 51,176,358.60            | 99.43         |

### 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                                                                  | 本期末（2020 年 12 月 31 日）           | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
|    | 市场基准上升 5%                                                        | 1,992,494.53                    | 1,879,326.05           |
|    | 市场基准下降 5%                                                        | -1,992,494.53                   | -1,879,326.05          |

注：股票市场基准取沪深 300 指数。

### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 40,477,074.38 元，属于第二层次的余额为人民币 2,280,645.59 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（上年度末：属于第一层次的余额为人民币 47,084,415.20 元，属于第二层次的余额为人民币 3,324,750.00 元，属于第三层次的余额为人民币 767,193.40 元）。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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

**7.4.14.2 承诺事项**

无。

**7.4.14.3 其他事项**

无。

**7.4.14.4 财务报表的批准**

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 40,490,621.57 | 92.48         |
|    | 其中：股票             | 40,490,621.57 | 92.48         |
| 2  | 基金投资              | —             | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 2,267,098.40  | 5.18          |
|    | 其中：债券             | 2,267,098.40  | 5.18          |
|    | 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      | 652,124.53    | 1.49          |
| 8  | 其他各项资产            | 371,950.70    | 0.85          |
| 9  | 合计                | 43,781,795.20 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —             | —             |
| B  | 采矿业              | 1,114,800.00  | 2.58          |
| C  | 制造业              | 26,563,576.27 | 61.47         |
| 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           | 879,620.00    | 2.04          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,235,220.00  | 2.86          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,380,532.30  | 3.19          |
| J  | 金融业              | 7,824,573.00  | 18.11         |
| K  | 房地产业             | —             | —             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,129,800.00  | 2.61          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —             | —             |
| 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          | —             | —             |

|   |           |               |       |
|---|-----------|---------------|-------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 362,500.00    | 0.84  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 40,490,621.57 | 93.70 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

### 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         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 002460 | 赣锋锂业 | 34,962  | 3,538,154.40 | 8.19         |
| 2  | 601012 | 隆基股份 | 30,000  | 2,766,000.00 | 6.40         |
| 3  | 300568 | 星源材质 | 53,000  | 1,604,310.00 | 3.71         |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 800     | 1,598,400.00 | 3.70         |
| 5  | 600893 | 航发动力 | 25,000  | 1,483,750.00 | 3.43         |
| 6  | 300601 | 康泰生物 | 8,500   | 1,483,250.00 | 3.43         |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 17,000  | 1,478,660.00 | 3.42         |
| 8  | 000858 | 五粮液  | 4,700   | 1,371,695.00 | 3.17         |
| 9  | 300059 | 东方财富 | 41,800  | 1,295,800.00 | 3.00         |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 60,000  | 1,252,200.00 | 2.90         |
| 11 | 002352 | 顺丰控股 | 14,000  | 1,235,220.00 | 2.86         |
| 12 | 603290 | 斯达半导 | 5,000   | 1,204,500.00 | 2.79         |
| 13 | 300037 | 新宙邦  | 11,500  | 1,166,100.00 | 2.70         |
| 14 | 603501 | 韦尔股份 | 5,000   | 1,155,500.00 | 2.67         |
| 15 | 600741 | 华域汽车 | 40,000  | 1,152,800.00 | 2.67         |
| 16 | 601888 | 中国中免 | 4,000   | 1,129,800.00 | 2.61         |
| 17 | 601899 | 紫金矿业 | 120,000 | 1,114,800.00 | 2.58         |
| 18 | 603533 | 掌阅科技 | 33,000  | 1,108,800.00 | 2.57         |
| 19 | 000001 | 平安银行 | 55,800  | 1,079,172.00 | 2.50         |
| 20 | 002311 | 海大集团 | 15,000  | 982,500.00   | 2.27         |
| 21 | 600597 | 光明乳业 | 58,000  | 943,080.00   | 2.18         |
| 22 | 603806 | 福斯特  | 11,000  | 939,400.00   | 2.17         |
| 23 | 601009 | 南京银行 | 115,000 | 929,200.00   | 2.15         |
| 24 | 603883 | 老百姓  | 14,000  | 879,620.00   | 2.04         |
| 25 | 600862 | 中航高科 | 28,000  | 842,800.00   | 1.95         |
| 26 | 600036 | 招商银行 | 18,000  | 791,100.00   | 1.83         |
| 27 | 600276 | 恒瑞医药 | 7,000   | 780,220.00   | 1.81         |
| 28 | 300390 | 天华超净 | 30,000  | 738,000.00   | 1.71         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 29 | 000739 | 普洛药业 | 30,000 | 698,400.00 | 1.62 |
| 30 | 601601 | 中国太保 | 18,000 | 691,200.00 | 1.60 |
| 31 | 002601 | 龙蟠佰利 | 20,000 | 615,400.00 | 1.42 |
| 32 | 000651 | 格力电器 | 8,000  | 495,520.00 | 1.15 |
| 33 | 002938 | 鹏鼎控股 | 8,000  | 397,360.00 | 0.92 |
| 34 | 300413 | 芒果超媒 | 5,000  | 362,500.00 | 0.84 |
| 35 | 002600 | 领益智造 | 30,000 | 359,700.00 | 0.83 |
| 36 | 601336 | 新华保险 | 5,300  | 307,241.00 | 0.71 |
| 37 | 688023 | 安恒信息 | 1,000  | 260,100.00 | 0.60 |
| 38 | 600887 | 伊利股份 | 5,000  | 221,850.00 | 0.51 |
| 39 | 003029 | 吉大正元 | 445    | 11,632.30  | 0.03 |
| 40 | 003028 | 振邦智能 | 272    | 11,339.68  | 0.03 |
| 41 | 605277 | 新亚电子 | 291    | 4,932.45   | 0.01 |
| 42 | 003030 | 祖名股份 | 312    | 4,736.16   | 0.01 |
| 43 | 003031 | 中瓷电子 | 254    | 3,878.58   | 0.01 |

## 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  | 000858 | 五粮液  | 5,984,069.18 | 11.63          |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 4,902,437.38 | 9.52           |
| 3  | 600438 | 通威股份 | 4,116,532.53 | 8.00           |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 3,827,256.04 | 7.44           |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 3,714,188.84 | 7.22           |
| 6  | 000651 | 格力电器 | 3,702,171.24 | 7.19           |
| 7  | 002460 | 赣锋锂业 | 3,617,598.10 | 7.03           |
| 8  | 002601 | 龙蟠佰利 | 3,604,428.00 | 7.00           |
| 9  | 600196 | 复星医药 | 3,377,314.00 | 6.56           |
| 10 | 603730 | 岱美股份 | 3,114,040.20 | 6.05           |
| 11 | 002352 | 顺丰控股 | 3,025,447.00 | 5.88           |
| 12 | 300498 | 温氏股份 | 3,009,487.00 | 5.85           |
| 13 | 601012 | 隆基股份 | 3,008,688.00 | 5.85           |
| 14 | 600741 | 华域汽车 | 2,938,438.00 | 5.71           |
| 15 | 002475 | 立讯精密 | 2,877,174.00 | 5.59           |
| 16 | 002930 | 宏川智慧 | 2,802,571.00 | 5.44           |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 17 | 600030 | 中信证券  | 2,797,530.00 | 5.44 |
| 18 | 002415 | 海康威视  | 2,746,855.00 | 5.34 |
| 19 | 300601 | 康泰生物  | 2,690,686.00 | 5.23 |
| 20 | 600519 | 贵州茅台  | 2,574,743.79 | 5.00 |
| 21 | 603786 | 科博达   | 2,535,534.00 | 4.93 |
| 22 | 002714 | 牧原股份  | 2,468,883.00 | 4.80 |
| 23 | 600887 | 伊利股份  | 2,403,585.90 | 4.67 |
| 24 | 000876 | 新希望   | 2,360,155.00 | 4.59 |
| 25 | 000661 | 长春高新  | 2,195,112.99 | 4.26 |
| 26 | 600000 | 浦发银行  | 2,193,598.00 | 4.26 |
| 27 | 002027 | 分众传媒  | 2,191,869.00 | 4.26 |
| 28 | 002602 | 世纪华通  | 2,155,391.00 | 4.19 |
| 29 | 300271 | 华宇软件  | 2,134,125.00 | 4.15 |
| 30 | 002463 | 沪电股份  | 2,079,973.00 | 4.04 |
| 31 | 603501 | 韦尔股份  | 1,984,922.00 | 3.86 |
| 32 | 601225 | 陕西煤业  | 1,976,479.00 | 3.84 |
| 33 | 601288 | 农业银行  | 1,900,669.00 | 3.69 |
| 34 | 000725 | 京东方 A | 1,900,499.00 | 3.69 |
| 35 | 600036 | 招商银行  | 1,806,932.00 | 3.51 |
| 36 | 300035 | 中科电气  | 1,792,679.00 | 3.48 |
| 37 | 002555 | 三七互娱  | 1,753,032.00 | 3.41 |
| 38 | 600585 | 海螺水泥  | 1,722,900.44 | 3.35 |
| 39 | 002508 | 老板电器  | 1,674,331.40 | 3.25 |
| 40 | 688007 | 光峰科技  | 1,673,710.30 | 3.25 |
| 41 | 000961 | 中南建设  | 1,647,369.00 | 3.20 |
| 42 | 603533 | 掌阅科技  | 1,621,250.00 | 3.15 |
| 43 | 603659 | 璞泰来   | 1,611,009.00 | 3.13 |
| 44 | 002600 | 领益智造  | 1,524,531.00 | 2.96 |
| 45 | 600872 | 中炬高新  | 1,518,396.00 | 2.95 |
| 46 | 601939 | 建设银行  | 1,508,604.75 | 2.93 |
| 47 | 601166 | 兴业银行  | 1,508,295.37 | 2.93 |
| 48 | 000671 | 阳光城   | 1,476,888.00 | 2.87 |
| 49 | 601857 | 中国石油  | 1,474,486.00 | 2.86 |
| 50 | 000063 | 中兴通讯  | 1,457,337.00 | 2.83 |
| 51 | 688126 | 沪硅产业  | 1,386,503.62 | 2.69 |
| 52 | 601899 | 紫金矿业  | 1,374,417.00 | 2.67 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 53 | 300568 | 星源材质 | 1,368,704.84 | 2.66 |
| 54 | 603160 | 汇顶科技 | 1,307,988.00 | 2.54 |
| 55 | 000739 | 普洛药业 | 1,294,846.43 | 2.52 |
| 56 | 603658 | 安图生物 | 1,247,135.00 | 2.42 |
| 57 | 002032 | 苏泊尔  | 1,245,166.00 | 2.42 |
| 58 | 601009 | 南京银行 | 1,215,718.00 | 2.36 |
| 59 | 000002 | 万科 A | 1,203,269.00 | 2.34 |
| 60 | 601319 | 中国人保 | 1,193,446.00 | 2.32 |
| 61 | 603290 | 斯达半导 | 1,183,636.38 | 2.30 |
| 62 | 002024 | 苏宁易购 | 1,180,913.00 | 2.29 |
| 63 | 300390 | 天华超净 | 1,178,071.00 | 2.29 |
| 64 | 601988 | 中国银行 | 1,166,059.00 | 2.27 |
| 65 | 300782 | 卓胜微  | 1,159,419.00 | 2.25 |
| 66 | 300037 | 新宙邦  | 1,157,873.00 | 2.25 |
| 67 | 601377 | 兴业证券 | 1,144,631.00 | 2.22 |
| 68 | 600893 | 航发动力 | 1,129,205.00 | 2.19 |
| 69 | 000157 | 中联重科 | 1,128,157.00 | 2.19 |
| 70 | 603806 | 福斯特  | 1,113,637.00 | 2.16 |
| 71 | 002216 | 三全食品 | 1,109,563.00 | 2.16 |
| 72 | 601888 | 中国中免 | 1,104,353.00 | 2.15 |
| 73 | 300572 | 安车检测 | 1,085,465.00 | 2.11 |
| 74 | 600009 | 上海机场 | 1,084,704.00 | 2.11 |
| 75 | 000001 | 平安银行 | 1,072,793.00 | 2.08 |
| 76 | 600867 | 通化东宝 | 1,063,222.00 | 2.07 |
| 77 | 603883 | 老百姓  | 1,055,303.00 | 2.05 |
| 78 | 002007 | 华兰生物 | 1,048,935.00 | 2.04 |
| 79 | 601901 | 方正证券 | 1,043,316.00 | 2.03 |

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 000858 | 五粮液  | 5,896,396.00 | 11.46          |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 5,256,254.27 | 10.21          |
| 3  | 600438 | 通威股份 | 4,793,301.63 | 9.31           |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 4,593,799.82 | 8.93           |
| 5  | 600276 | 恒瑞医药 | 4,019,713.80 | 7.81           |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 6  | 002601 | 龙蟠佰利  | 3,717,330.00 | 7.22 |
| 7  | 601318 | 中国平安  | 3,473,647.00 | 6.75 |
| 8  | 600196 | 复星医药  | 3,360,308.00 | 6.53 |
| 9  | 603730 | 岱美股份  | 3,332,302.35 | 6.47 |
| 10 | 600036 | 招商银行  | 3,184,272.00 | 6.19 |
| 11 | 601688 | 华泰证券  | 3,179,076.00 | 6.18 |
| 12 | 002475 | 立讯精密  | 3,060,858.00 | 5.95 |
| 13 | 601939 | 建设银行  | 3,043,737.00 | 5.91 |
| 14 | 600016 | 民生银行  | 3,041,884.00 | 5.91 |
| 15 | 000651 | 格力电器  | 2,984,852.00 | 5.80 |
| 16 | 601818 | 光大银行  | 2,916,843.00 | 5.67 |
| 17 | 600900 | 长江电力  | 2,858,363.92 | 5.55 |
| 18 | 002930 | 宏川智慧  | 2,755,893.68 | 5.35 |
| 19 | 300498 | 温氏股份  | 2,723,833.26 | 5.29 |
| 20 | 002415 | 海康威视  | 2,695,640.00 | 5.24 |
| 21 | 600030 | 中信证券  | 2,645,362.43 | 5.14 |
| 22 | 002714 | 牧原股份  | 2,641,001.90 | 5.13 |
| 23 | 601012 | 隆基股份  | 2,590,983.59 | 5.03 |
| 24 | 603786 | 科博达   | 2,582,225.00 | 5.02 |
| 25 | 000661 | 长春高新  | 2,580,996.00 | 5.01 |
| 26 | 002602 | 世纪华通  | 2,580,636.62 | 5.01 |
| 27 | 600887 | 伊利股份  | 2,514,980.00 | 4.89 |
| 28 | 000876 | 新希望   | 2,512,541.82 | 4.88 |
| 29 | 002027 | 分众传媒  | 2,428,479.00 | 4.72 |
| 30 | 002352 | 顺丰控股  | 2,258,861.24 | 4.39 |
| 31 | 600498 | 烽火通信  | 2,238,019.00 | 4.35 |
| 32 | 600000 | 浦发银行  | 2,196,714.00 | 4.27 |
| 33 | 300271 | 华宇软件  | 2,194,021.00 | 4.26 |
| 34 | 002460 | 赣锋锂业  | 2,164,858.00 | 4.21 |
| 35 | 600926 | 杭州银行  | 2,109,422.32 | 4.10 |
| 36 | 600741 | 华域汽车  | 2,083,470.28 | 4.05 |
| 37 | 300035 | 中科电气  | 2,069,446.00 | 4.02 |
| 38 | 601601 | 中国太保  | 2,044,829.00 | 3.97 |
| 39 | 601319 | 中国人保  | 2,036,311.00 | 3.96 |
| 40 | 002463 | 沪电股份  | 2,018,901.00 | 3.92 |
| 41 | 600015 | 华夏银行  | 1,965,801.00 | 3.82 |
| 42 | 000725 | 京东方 A | 1,889,050.00 | 3.67 |
| 43 | 601225 | 陕西煤业  | 1,862,395.89 | 3.62 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 44 | 601288 | 农业银行 | 1,857,225.00 | 3.61 |
| 45 | 600999 | 招商证券 | 1,847,254.00 | 3.59 |
| 46 | 600585 | 海螺水泥 | 1,811,572.00 | 3.52 |
| 47 | 601166 | 兴业银行 | 1,805,772.00 | 3.51 |
| 48 | 601989 | 中国重工 | 1,777,469.00 | 3.45 |
| 49 | 601009 | 南京银行 | 1,767,326.14 | 3.43 |
| 50 | 002555 | 三七互娱 | 1,765,857.00 | 3.43 |
| 51 | 002508 | 老板电器 | 1,681,969.11 | 3.27 |
| 52 | 600919 | 江苏银行 | 1,654,762.00 | 3.21 |
| 53 | 603659 | 璞泰来  | 1,638,241.00 | 3.18 |
| 54 | 601336 | 新华保险 | 1,625,008.00 | 3.16 |
| 55 | 688007 | 光峰科技 | 1,623,638.79 | 3.15 |
| 56 | 601628 | 中国人寿 | 1,623,592.00 | 3.15 |
| 57 | 000961 | 中南建设 | 1,619,458.58 | 3.15 |
| 58 | 600872 | 中炬高新 | 1,584,739.00 | 3.08 |
| 59 | 600886 | 国投电力 | 1,548,663.00 | 3.01 |
| 60 | 000671 | 阳光城  | 1,535,785.00 | 2.98 |
| 61 | 601668 | 中国建筑 | 1,486,132.00 | 2.89 |
| 62 | 601857 | 中国石油 | 1,450,951.00 | 2.82 |
| 63 | 688126 | 沪硅产业 | 1,444,522.00 | 2.81 |
| 64 | 601169 | 北京银行 | 1,415,263.00 | 2.75 |
| 65 | 601006 | 大秦铁路 | 1,386,153.00 | 2.69 |
| 66 | 000063 | 中兴通讯 | 1,383,415.00 | 2.69 |
| 67 | 601328 | 交通银行 | 1,353,628.00 | 2.63 |
| 68 | 300601 | 康泰生物 | 1,347,576.00 | 2.62 |
| 69 | 300122 | 智飞生物 | 1,321,603.60 | 2.57 |
| 70 | 603658 | 安图生物 | 1,305,956.00 | 2.54 |
| 71 | 603160 | 汇顶科技 | 1,276,551.00 | 2.48 |
| 72 | 603288 | 海天味业 | 1,261,400.00 | 2.45 |
| 73 | 002032 | 苏泊尔  | 1,215,417.00 | 2.36 |
| 74 | 000002 | 万科 A | 1,203,764.00 | 2.34 |
| 75 | 601377 | 兴业证券 | 1,192,293.00 | 2.32 |
| 76 | 601988 | 中国银行 | 1,125,877.00 | 2.19 |
| 77 | 300782 | 卓胜微  | 1,110,420.00 | 2.16 |
| 78 | 002024 | 苏宁易购 | 1,102,789.00 | 2.14 |
| 79 | 002600 | 领益智造 | 1,096,314.00 | 2.13 |
| 80 | 300572 | 安车检测 | 1,088,717.00 | 2.12 |
| 81 | 300207 | 欣旺达  | 1,069,279.00 | 2.08 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 82 | 603259 | 药明康德 | 1,055,301.60 | 2.05 |
| 83 | 000157 | 中联重科 | 1,054,765.00 | 2.05 |
| 84 | 002216 | 三全食品 | 1,053,810.00 | 2.05 |
| 85 | 600009 | 上海机场 | 1,050,657.00 | 2.04 |
| 86 | 600436 | 片仔癀  | 1,046,249.00 | 2.03 |
| 87 | 601901 | 方正证券 | 1,045,271.00 | 2.03 |

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 | 241,008,828.92 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 263,516,319.80 |

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -            | -            |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,253,098.40 | 5.21         |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,253,098.40 | 5.21         |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 14,000.00    | 0.03         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 2,267,098.40 | 5.25         |

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 018013 | 国开 2004 | 22,540 | 2,253,098.40 | 5.21         |
| 2  | 113616 | 韦尔转债    | 140    | 14,000.00    | 0.03         |
| 3  | -      | -       | -      | -            | -            |
| 4  | -      | -       | -      | -            | -            |
| 5  | -      | -       | -      | -            | -            |

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券除赣锋锂业(002460), 国开 2004(018013) 外其他证券的发行主体本期未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。江西证监局 2020 年 04 月 13 日对江西赣锋锂业股份有限公司进行处罚(江西证监局[2020]2 号), 银保监会 2020 年 12 月 25 日对国家开发银行进行处罚(银保监罚决字〔2020〕67 号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作, 上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

### 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   | 17,337.06  |
| 2  | 应收证券清算款 | 309,518.00 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 37,465.33  |

|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 5 | 应收申购款 | 7,630.31   |
| 6 | 其他应收款 | —          |
| 7 | 待摊费用  | —          |
| 8 | 其他    | —          |
| 9 | 合计    | 371,950.70 |

#### 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债。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十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 |
| 鹏扬元合量化股票 A | 252      | 27,305.09  | 4,964,750.27  | 72.15% | 1,916,133.60 | 27.85% |
| 鹏扬元合量化股票 C | 159      | 137,109.49 | 20,191,073.88 | 92.62% | 1,609,335.47 | 7.38%  |
| 合计         | 411      | 69,784.17  | 25,155,824.15 | 87.71% | 3,525,469.07 | 12.29% |

注：对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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 | 鹏扬元合量化股票 A | 17,037.03 | 0.2476%  |
|                  | 鹏扬元合量化股票 C | 275.66    | 0.0013%  |
|                  | 合计         | 17,312.69 | 0.0604%  |

注：对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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 | 鹏扬元合量化股票 A | 0~10              |
|                                | 鹏扬元合量化股票 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 鹏扬元合量化股票 A | 0                 |
|                                | 鹏扬元合量化股票 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |

注：截至本报告期末，本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                            | 鹏扬元合量化股票 A    | 鹏扬元合量化股票 C     |
|-------------------------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 7 月 9 日）基金份额总额 | 53,299,335.93 | 159,587,034.34 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 9,447,628.47  | 39,429,389.40  |
| 本报告期基金总申购份额                   | 6,323,704.32  | 8,157,100.29   |
| 减:本报告期基金总赎回份额                 | 8,890,448.92  | 25,786,080.34  |
| 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                  | 6,880,883.87  | 21,800,409.35  |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人：

本基金管理人于 2020 年 7 月 24 日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》，朱国庆先生自 2020 年 7 月 22 日起担任鹏扬基金管理有限公司副总经理。本基金管理人于 2020 年 11 月 7 日发布《鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告》，卢安平先生自 2020 年 11 月 6 日起不再担任鹏扬基金管理有限公司副总经理。本基金管理人已按有关规定报中国基金业协会和北京证监局备案。

#### 2、基金托管人托管部门：

无。

### 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

本基金报告年度应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 50,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |             | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|-------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |

|      |   |                | 例      |            |        |   |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 中信建投 | 2 | 226,625,957.68 | 45.01% | 163,769.17 | 48.62% | - |
| 国信证券 | 2 | 106,148,675.60 | 21.08% | 75,502.78  | 22.42% | - |
| 中金公司 | 2 | 86,182,687.33  | 17.12% | 36,569.81  | 10.86% | - |
| 安信证券 | 2 | 84,526,162.66  | 16.79% | 60,984.77  | 18.11% | - |
| 东方证券 | 2 | -              | -      | -          | -      | - |

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

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。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

3、在上述租用的券商交易单元中，东方证券的交易单元为本基金本报告期内新增的交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易         |              | 债券回购交易        |                | 权证交易 |              |
|------|--------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投 | 5,391,252.00 | 50.82%       | 17,100,000.00 | 21.92%         | -    | -            |
| 国信证券 | 4,469,980.99 | 42.14%       | 40,000,000.00 | 51.28%         | -    | -            |
| 中金公司 | 706,999.00   | 6.67%        | 3,000,000.00  | 3.85%          | -    | -            |
| 安信证券 | 39,343.37    | 0.37%        | 17,900,000.00 | 22.95%         | -    | -            |
| 东方证券 | -            | -            | -             | -              | -    | -            |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                            | 法定披露方式          | 法定披露日期          |
|----|-------------------------------------------------|-----------------|-----------------|
| 1  | 鹏扬基金管理有限公司关于开展货币基金赎回转认购优惠费率的公告                  | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 1 月 15 日 |
| 2  | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议部分条款的公告            | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 1 月 17 日 |
| 3  | 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 | 2020 年 1 月 20 日 |
| 4  | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告              | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 1 月 20 日 |
| 5  | 鹏扬基金管理有限公司旗下基金在 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放时间等相关安排 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 1 月 30 日 |

|    |                                          |                 |                 |
|----|------------------------------------------|-----------------|-----------------|
|    | 调整的提示性公告                                 |                 |                 |
| 6  | 鹏扬基金管理有限公司关于开展直销柜台货币基金转换优惠费率的公告          | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 2 月 10 日 |
| 7  | 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 | 2020 年 2 月 27 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 | 2020 年 3 月 10 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 | 2020 年 3 月 19 日 |
| 10 | 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 | 2020 年 3 月 23 日 |
| 11 | 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 | 2020 年 3 月 24 日 |
| 12 | 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 | 2020 年 3 月 25 日 |
| 13 | 鹏扬基金管理有限公司关于延迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告     | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 3 月 25 日 |
| 14 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金的基金合作销售机构名称变更的公告         | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 3 月 27 日 |
| 15 | 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 | 2020 年 4 月 7 日  |
| 16 | 鹏扬基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告     | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 4 月 17 日 |
| 17 | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告       | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 4 月 21 日 |
| 18 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2019 年年度报告           | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 4 月 21 日 |
| 19 | 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 | 2020 年 4 月 22 日 |
| 20 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告       | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 4 月 22 日 |
| 21 | 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 | 2020 年 4 月 28 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 | 2020 年 4 月 30 日 |
| 23 | 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 | 2020 年 6 月 3 日  |
| 24 | 鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金增聘基金经理的公告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 6 月 11 日 |
| 25 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金更新的招募说明书及摘要           | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 6 月 11 日 |
| 26 | 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 | 2020 年 6 月 19 日 |
| 27 | 鹏扬基金管理有限公司关于深圳分公司办公地址变                   | 证监会指定报刊         | 2020 年 6 月 30 日 |

|    |                                          |                 |                 |
|----|------------------------------------------|-----------------|-----------------|
|    | 更的公告                                     | 及网站、公司官网        |                 |
| 28 | 鹏扬基金管理有限公司旗下部分基金在北京蛋卷基金销售有限公司开展费率优惠活动的公告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 1 日  |
| 29 | 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 | 2020 年 7 月 9 日  |
| 30 | 鹏扬基金管理有限公司关于上海分公司办公地址变更的公告               | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 16 日 |
| 31 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金招募说明书                 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 17 日 |
| 32 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金合同                  | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 17 日 |
| 33 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金托管协议                  | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 17 日 |
| 34 | 关于鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金修改基金合同等法律文件的公告      | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 17 日 |
| 35 | 鹏扬基金管理有限公司关于鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金变更基金经理的公告 | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 21 日 |
| 36 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告       | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 21 日 |
| 37 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金更新的招募说明书摘要            | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 22 日 |
| 38 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金更新的招募说明书              | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 22 日 |
| 39 | 鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告                     | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 24 日 |
| 40 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金的基金合作销售机构名称变更的公告         | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 7 月 29 日 |
| 41 | 鹏扬基金管理有限公司关于直销柜台办公地址变更的公告                | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 8 月 3 日  |
| 42 | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告       | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 8 月 25 日 |
| 43 | 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 | 2020 年 8 月 26 日 |
| 44 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2020 年中期报告           | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 8 月 29 日 |
| 45 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型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 | 2020 年 8 月 31 日 |
| 46 | 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 | 2020 年 9 月 11 日 |
| 47 | 鹏扬基金管理有限公司关于增加基金合作销售机构并参加费率优惠活动的公告       | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 9 月 17 日 |
| 48 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下基金的基金合作销售机构名称变更的公告         | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 9 月 23 日 |
| 49 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在                   | 证监会指定报刊         | 2020 年 9 月 28 日 |

|    |                                                |                 |                  |
|----|------------------------------------------------|-----------------|------------------|
|    | 代销渠道开展费率优惠活动的公告                                | 及网站、公司官网        |                  |
| 50 | 鹏扬基金管理有限公司关于修订旗下部分证券投资基金基金合同等法律文件的公告           | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 10 月 16 日 |
| 51 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金合同                        | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 10 月 16 日 |
| 52 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金托管协议                        | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 10 月 16 日 |
| 53 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金更新的招募说明书（2020 年第 4 号）       | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 10 月 21 日 |
| 54 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金（鹏扬元合量化股票 A 份额）基金产品资料概要（更新） | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 10 月 21 日 |
| 55 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金（鹏扬元合量化股票 C 份额）基金产品资料概要（更新） | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 10 月 21 日 |
| 56 | 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 | 2020 年 10 月 26 日 |
| 57 | 鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告             | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 10 月 28 日 |
| 58 | 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 | 2020 年 11 月 3 日  |
| 59 | 鹏扬基金管理有限公司高级管理人员变动公告                           | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 11 月 7 日  |
| 60 | 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 | 2020 年 11 月 10 日 |
| 61 | 鹏扬基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国工商银行股份有限公司开展费率优惠活动的公告  | 证监会指定报刊及网站、公司官网 | 2020 年 12 月 29 日 |
| 62 | 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 | 2020 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

| 投资者类别                                                                                                                                                                                        | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                   |               |              |              | 报告期末持有基金情况    |        |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------------------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------|
|                                                                                                                                                                                              | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间           | 期初份额          | 申购份额         | 赎回份额         | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构                                                                                                                                                                                           | 1              | 2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 12 月 31 日 | 13,900,247.30 | 4,438,526.41 | 7,280,000.00 | 11,058,773.71 | 38.56% |
| 个人                                                                                                                                                                                           | -              | -                                 | -             | -            | -            | -             | -      |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                       |                |                                   |               |              |              |               |        |
| <p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引起基金的流动性风险。本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。</p> |                |                                   |               |              |              |               |        |

### 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. 中国证监会批准鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金募集的文件；
2. 《鹏扬元合量化大盘优选股票型证券投资基金基金合同》；
3. 《鹏扬元合量化大盘优选股票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

2021 年 3 月 30 日