
人保中证 500 指数型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:中国人保资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63

8.3 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情况	63
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	人保中证500指数型证券投资基金
基金简称	人保中证500
基金主代码	006611
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月07日
基金管理人	中国人保资产管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	83,857,281.92份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证500指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资策略	本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。

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	中国人保资产管理有限公司	交通银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	吕传红	陆志俊
	联系电话	010-69009696	95559
	电子邮箱	lvch@piccamc.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-820-7999	95559
传真		021-50765598	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大厦1198号20层、21层、22层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		北京市西城区西长安街88号 中国人保大厦8层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		100031	200336
法定代表人		缪建民	任德奇

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国人保资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大厦1198号20层、21层、22层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年01月01日- 2020年06月30日）
本期已实现收益	15,141,338.81

本期利润	17,824,222.69
加权平均基金份额本期利润	0.1563
本期加权平均净值利润率	12.34%
本期基金份额净值增长率	13.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020年06月30日）
期末可供分配利润	31,678,088.25
期末可供分配基金份额利润	0.3778
期末基金资产净值	115,535,370.17
期末基金份额净值	1.3778
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020年06月30日）
基金份额累计净值增长率	37.78%

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、期末可供分配利润是指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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	8.41%	0.82%	8.04%	0.84%	0.37%	-0.02%
过去三个月	16.66%	1.06%	15.47%	1.08%	1.19%	-0.02%
过去六个月	13.73%	1.67%	10.84%	1.70%	2.89%	-0.03%
过去一年	23.80%	1.36%	17.63%	1.39%	6.17%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	37.78%	1.44%	31.39%	1.48%	6.39%	-0.04%

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

人保中证500指数型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于2018年12月7日生效。根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月，建仓期满，本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

2、本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%

§ 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

中国人保资产管理有限公司（简称人保资产）成立于2003年7月16日，是经国务院同意、原中国保监会批准，由中国人民保险集团股份有限公司（股票代码：601319.SH, 1339.HK）发起设立的境内第一家保险资产管理公司。目前管理资产逾万亿元人民币，具备保监会核准的股票投资能力、无担保债券投资能力、股权投资能力、基础设施投资计划产品创新能力、不动产投资计划产品创新能力、衍生品运用能力（股指期货）和信托产品投资能力，具有国家外管局批准的经营外汇业务资格，获选基本养老保险基金证券投资基金管理机构，获准发行投资理财产品和受托管理合格投资者资金，获批开展公募基金业务，是中国资本市场秉持价值投资理念、为客户创造绝对收益的重要机构投资者之一。

成立十余年来，人保资产以保险资金运用为主业，基于资产负债匹配管理理念，探索建立了从资产战略配置、资产战术配置、资产交易配置到集中交易和全流程风险管控的资产管理价值链，并着眼于构建能够获得持续稳定收益的资产组合，坚持以绝对收益为核心的收益缺口管理原则，为委托人贡献了长期稳定的投资收益。

十余年来，中国金融市场日趋成熟，财富管理行业日渐交融。人保资产科学筹划发展战略，积极把握第三方业务的发展机遇和另类资产的投资机会，在国内保险资产管理机构中较早开展了第三方保险机构的专户管理和企业年金与养老金投资管理业务，并积极开展和开展股权投资、基础设施债权投资业务、资产管理产品等业务，积极筹备公募基金业务，形成了专户管理、资产管理产品、债权投资计划、股权投资计划、不动产投资计划、企业年金、养老金产品和外汇投资等业务多元化发展的格局，与国内各主要金融机构和大中型龙头企业建立了良好的合作关系。

自成立以来，人保资产始终坚持专业化发展、市场化经营、规范化运作，是第一家建立“委托-受托-托管”资金三方存管机制的保险资产管理机构，并探索建立了覆盖投资全流程的风险防控体系；十余年来，人保资产还培养了具备国际投资视野、历经市场多周期磨练的投研管理和业务执行团队，忠实履行了对各委托人的价值创造承诺。

面向潜力无限、变革加快、竞争激烈的财富管理市场，人保资产将始终坚持人民至上，牢记“人民保险，服务人民”的企业使命，恪守“理念立司、专业兴司、创新强司、正气治司”的企业核心价值观，实现“做人民信赖的卓越品牌”的企业愿景。

人保资产于2017年1月11日获得中国证监会《关于核准中国人保资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]107号），于2017年3月29日获得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。截至2020年6月30日，本公司旗下共管理24只基金产品，产品线逐渐丰富，涵盖了股票指数型、债券型、混合型、货币型产品，基金分别为人保货币市场基金、人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基金、人保纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保量化基本面混合型证券投资基金、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保安惠三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保优势产业混合型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保福睿18个月定期开放债券型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金、人保添益6个月定期开放债券型证券投资基金、人保利璟纯债债券型证券投资基金、人保中高等级信用债债券型证券投资基金、人保鑫享短债债券型证券投资基金、人保添利9个月定期开放债券型证券投资基金、人保鑫选双债债券型证券投资基金。

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		
刘笑明	基金经理	2018-12-07	2020-04-02	6 年	北京大学化学学士、经济学学士，哥伦比亚大学运筹学硕士。曾任建信基金衍生品及量化投资部研究员、投资经理，北京极至投资管理有限公司投资经理。2017年6月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，2018年9月27日起至2020年4月2日任人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理，2018年12月7日起至2020年4月2日任人保中证500指数型证券投资基金基金经理，2019年2月28日起至2020年4月2日任人保沪深300指数型证券投资基金基金经理。
彬彬	基金经理	2020-04-02	-	10 年	澳大利亚伍伦贡大学商学硕士。曾任中国人民财产保险股份有限公司资金运营部业务主办、主管。2017年11月加入中国人保资产管理公司公募基金事业部任基金经理助理。2019年1月15日起任人保优势

					产业混合型证券投资基金基金经理。自2020年4月2日起任人保沪深300指数型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金和人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为本基金合同生效日。

2、非首任基金经理，其“任职日期”为公告确定的聘任日期。

3、2020年4月8日，公司发布了《人保中证500指数型证券投资基金基金经理变更公告》，自2020年4月2日起增聘彬彬为本基金的基金经理、解聘刘笑明担任本基金的基金经理，上述事项已按规定在中国证券投资基金业协会办理变更手续，并报中国证监会北京证监局备案。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下所有公募基金投资组合，建立了公平交易制度和流程。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有公募基金投资组合，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，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

报告期内，基金管理人根据基金合同约定，以坚持被动指数化投资为原则进行基金的投资运作，并通过定量技术对基金跟踪误差进行监控及分析。报告期内基金跟踪误差来源主要是：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票；2) 基金的申购赎回；3) 成份股票的停牌。

本基金作为一只跟踪中证500指数的被动指数产品，基金管理人将运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保中证500基金份额净值为1.3778元，本报告期内，基金份额净值增长率为13.73%，同期业绩比较基准收益率为10.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，2020年受到新冠疫情的影响一二季度的宏观经济受到较大冲击。但随着国内疫情基本得到控制，国民经济和企业盈利回到了复苏的轨道上。同时较为宽松的货币和财政政策以及对于资本市场愈加重视的趋势在2020年下半年不会改变。

证券市场及行业走势方面，2020年上半年主要走势分化较为明显，其中沪深300指数上涨1.64%，中证500指数上涨11.33%，创业板指数上涨35.60%。展望2020年下半年，股票市场流动性有望继续在国内货币政策基调相对宽松、海外资本持续流入以及居民财富再配置的大背景下获得较强支撑，并在中长期随着上市公司业绩的逐步改善和增长而取得合理的收益。同时，国内和海外的疫情是否有二次爆发的情况，我国面临的国际局势的不确定性，也会给市场带来较大不确定性。伴随国内经济结构性调整的深入，市场行情的演绎也有望出现相应的结构性变化，收入体量较大、业绩稳定且市场份额较高的价值型公司仍将是投资者进行配置的核心标的，但具有业绩支撑的新兴产业高成长性公司将有可能随着风险偏好的逐步提升而获得超越市场平均水平的回报。

本基金作为一只跟踪中证500指数的被动指数产品，基金管理人将运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照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有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值

委员会，成员主要由公募基金事业部投资部门、研究部门、合规风控部门及公司运营管理部门人员组成，以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理列席会议，但不参与具体决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2020年上半年度，基金托管人在人保中证500指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2020年上半年度，中国人保资产管理有限公司在人保中证500指数型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

2020年上半年度，由中国人保资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关人保中证500指数型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,599,501.59	1,871,249.00
结算备付金		-	91,285.24
存出保证金		33,578.12	52,400.68
交易性金融资产	6.4.7.2	114,181,337.50	178,185,337.68
其中：股票投资		108,714,149.00	169,136,077.18
基金投资		-	-
债券投资		5,467,188.50	9,049,260.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	175,566.35
应收利息	6.4.7.5	174,643.00	186,222.06
应收股利		-	-
应收申购款		417,688.09	114,733.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		116,406,748.30	180,676,794.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		238,828.11	19.24
应付赎回款		373,243.38	500,495.58
应付管理人报酬		41,150.50	67,544.20
应付托管费		9,144.54	15,009.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	83,200.93	95,259.59
应交税费		0.21	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	125,810.46	81,523.80
负债合计		871,378.13	759,852.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	83,857,281.92	148,511,296.02
未分配利润	6.4.7.10	31,678,088.25	31,405,646.04
所有者权益合计		115,535,370.17	179,916,942.06
负债和所有者权益总计		116,406,748.30	180,676,794.29

注：报告截止日2020年6月30日，基金份额净值为人民币1.3778元，基金份额总额83,857,281.92份。

6.2 利润表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		18,710,083.77	18,518,116.86
1. 利息收入		143,336.42	74,617.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,981.82	12,773.84
债券利息收入		129,354.60	61,844.13

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,805,892.13	10,803,529.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,011,272.84	10,253,248.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-18,286.56	-24,907.30
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	812,905.85	575,188.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,682,883.88	7,498,870.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	77,971.34	141,098.55
减：二、费用		885,861.08	664,209.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	324,548.65	160,752.87
2. 托管费	6.4.10.2. 2	72,121.93	35,722.87
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	312,449.02	299,864.10
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产		-	-

支出			
6. 税金及附加		0.02	-
7. 其他费用	6.4.7.20	176,741.46	167,869.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,824,222.69	17,853,907.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,824,222.69	17,853,907.84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30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）	148,511,296.02	31,405,646.04	179,916,942.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,824,222.69	17,824,222.69
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）	-64,654,014.10	-17,551,780.48	-82,205,794.58
其中：1. 基金申购款	37,767,689.68	10,200,963.58	47,968,653.26
2. 基金赎回款	-102,421,703.78	-27,752,744.06	-130,174,447.84
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)	83,857,281.92	31,678,088.25	115,535,370.17
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30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)	116,393,125.16	-5,179,663.29	111,213,461.87
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	17,853,907.84	17,853,907.84
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)	-45,890,379.57	-4,715,962.99	-50,606,342.56
其中：1. 基金申购款	54,494,364.98	6,552,538.18	61,046,903.16
2. 基金赎回款	-100,384,744.55	-11,268,501.17	-111,653,245.72
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)	70,502,745.59	7,958,281.56	78,461,027.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

曾北川

韩松

沈静

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

人保中证500指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人中国人保资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《人保中证500指数型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]1723号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为255,386,460.94份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第00367号验资报告。基金合同于2018年12月7日正式生效。本基金的基金管理人为中国人保资产管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(包括分离交易可转债))、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款等)、货币市场工具、金融衍生工具(包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等)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(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权需缴纳的现金保证金后,持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准:中证500指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2020年6月30日的财务状况以及2020年1月1日至2020年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 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、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 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，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对于基金从事A股买卖, 出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	1, 599, 501. 59
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	1, 599, 501. 59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末2020年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		96, 616, 237. 41	108, 714, 149. 00	12, 097, 911. 59
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5, 503, 988. 75	5, 467, 188. 50	-36, 800. 25
	银行间市场	-	-	-
	合计	5, 503, 988. 75	5, 467, 188. 50	-36, 800. 25
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	102, 120, 226. 16	114, 181, 337. 50	12, 061, 111. 34

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	289. 77
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	-
应收债券利息	174, 338. 03
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	15. 20
合计	174, 643. 00

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	83,200.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	83,200.93

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,219.58
应付证券出借违约金	-
预提费用	74,590.88
其他应付	50,000.00
合计	125,810.46

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	148,511,296.02	148,511,296.02
本期申购	37,767,689.68	37,767,689.68
本期赎回（以“-”号填列）	-102,421,703.78	-102,421,703.78
本期末	83,857,281.92	83,857,281.92

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,260,435.25	-4,854,789.21	31,405,646.04
本期利润	15,141,338.81	2,682,883.88	17,824,222.69
本期基金份额交易产生的变动数	-19,042,224.64	1,490,444.16	-17,551,780.48
其中：基金申购款	10,920,382.01	-719,418.43	10,200,963.58
基金赎回款	-29,962,606.65	2,209,862.59	-27,752,744.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,359,549.42	-681,461.17	31,678,088.25

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	13,029.08
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	581.49
其他	371.25
合计	13,981.82

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	139,838,290.80
减：卖出股票成本总额	124,827,017.96
买卖股票差价收入	15,011,272.84

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30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	-18,286.56
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	-18,286.56

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,487,455.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,331,108.12
减：应收利息总额	174,634.14
买卖债券差价收入	-18,286.56

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	812,905.85

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	812,905.85

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	2,682,883.88
——股票投资	2,703,627.26
——债券投资	-20,743.38
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,682,883.88

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	77,970.70
转换费收入	0.64
合计	77,971.34

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	312,449.02
银行间市场交易费用	—
合计	312,449.02

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
汇划手续费	2,150.58
其他费用_指数使用费	100,000.00
合计	176,741.46

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国人保资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

中国人民保险集团股份有限公司

基金管理人控股股东

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，与本基金管理人同受一方控制的关联方发生的交易根据实际发生情况于下文分别列示。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	324,548.65	160,752.87
其中：支付销售机构的客户维护费	36,775.79	6,988.75

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.45%年费率计提。逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.45%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	72,121.93	35,722.87

注：支付的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至2020年06 月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06 月30日
----	-----------------------------------	--

基金合同生效日（2018年12月07日）持有的基金份额	19,999,000.00	19,999,000.00
报告期初持有的基金份额	7,199,000.00	19,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	7,199,000.00	19,999,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.58%	28.37%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	1,599,501.59	13,029.08	661,470.55	9,580.54

注：本基金由基金托管交通银行股份有限公司保管的银行存款利息收入，按银行同业或协议利率计算。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688228	开普云	2020-03-19	2020-09-28	新股锁定	59.26	73.20	1,413	83,734.38	103,431.60	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开盘	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	------	------	------	-------	--------	--------	----

				单 价		单 价				
6018 80	大连 港	2020 -06- 22	-	1.72	2020 -07- 08	1.89	68,200	131,293.75	117,304.00	-
0024 70	*ST 金正	2020 -06- 30	-	2.27	2020 -07- 01	2.16	37,238	131,175.70	84,530.26	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在力求基金资产安全性、较高流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本基金的基金管理人建立了由董事会负最终责任、管理层直接领导、内部控制职能部门统筹协调、内部控制评价部门监察监督、业务职能部门负首要责任的分工明确、路线清晰、相互协作、有效执行的内部控制组织体系。公募基金事业部办公会议为公募基金业务日常运行管理的议事机构，负责事业部经营管理重要事项的研究与决定，以及拟提交公司审批事项的审核。

为加强公募基金管理的内部控制，防范和化解经营风险，提高经营管理效益，保障基金持有人利益，基金管理人遵照中国法律和公司章程的规定履行职责，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；公募基金事业部及各职能部门根据既定的业务规范、制度执行具体业务；监事会、风险管理委员会、风险控制部、监察审计部为公司不同层面的监督机构，构成公司相对独立的监督系统。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，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。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券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。本基金在进行银行间同业市场债券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。

本基金报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受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。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
----------------	------	------	------	-----	----

资产					
银行存款	1,599,501.59	-	-	-	1,599,501.59
存出保证金	33,578.12	-	-	-	33,578.12
交易性金融资产	5,467,188.50	-	-	108,714,149.00	114,181,337.50
应收利息	-	-	-	174,643.00	174,643.00
应收申购款	-	-	-	417,688.09	417,688.09
资产总计	7,100,268.21	-	-	109,306,480.09	116,406,748.30
负债					
应付证券清算款	-	-	-	238,828.11	238,828.11
应付赎回款	-	-	-	373,243.38	373,243.38
应付管理人报酬	-	-	-	41,150.50	41,150.50
应付托管费	-	-	-	9,144.54	9,144.54
应付交易费用	-	-	-	83,200.93	83,200.93
应交税费	-	-	-	0.21	0.21
其他负债	-	-	-	125,810.46	125,810.46
负债总计	-	-	-	871,378.13	871,378.13
利率敏感度缺口	7,100,268.21	-	-	108,435,101.96	115,535,370.17
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,871,249.00	-	-	-	1,871,249.00
结算备付金	91,285.24	-	-	-	91,285.24

存出保证金	52,400.68	-	-	-	52,400.68
交易性金融资产	9,049,260.50	-	-	169,136,077.18	178,185,337.68
应收证券清算款	-	-	-	175,566.35	175,566.35
应收利息	-	-	-	186,222.06	186,222.06
应收申购款	-	-	-	114,733.28	114,733.28
资产总计	11,064,195.42	-	-	169,612,598.87	180,676,794.29
负债					
应付证券清算款	-	-	-	19.24	19.24
应付赎回款	-	-	-	500,495.58	500,495.58
应付管理人报酬	-	-	-	67,544.20	67,544.20
应付托管费	-	-	-	15,009.82	15,009.82
应付交易费用	-	-	-	95,259.59	95,259.59
其他负债	-	-	-	81,523.80	81,523.80
负债总计	-	-	-	759,852.23	759,852.23
利率敏感度缺口	11,064,195.42	-	-	168,852,746.64	179,916,942.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
假设	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)	
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06月30日	上年度末 2019年12月31日
	1. 市场利率上升25个基点	-1, 173. 77	-9, 996. 12
	2. 市场利率下降25个基点	1, 176. 90	10, 032. 85

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

于2020年6月30日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 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	108, 714, 149. 00	94. 10	169, 136, 077. 18	94. 01
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投	—	—	—	—

资				
衍生金融资产	-	-	-	-
— 权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	108,714,149.00	94.10	169,136,077.18	94.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险		
	Beta系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性		
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06月30日	上年度末 2019年12月31日
	1. 业绩比较基准增加5%	5,227,975.50	8,495,282.52
	2. 业绩比较基准减少5%	-5,227,975.50	-8,495,282.52

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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、买入返售金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年6月30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工具中属于第一层次的余额为人民币108,382,229.16 元，第二层次的余额为人民币5,695,676.74元，第三层次的余额为人民币103,431.60元(于2019年12月31日，第一层次的余额为人民币168,779,838.61 元，第二层次的余额为人民币9,247,346.03 元，第三层次的余额为人民币158,153.04元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金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根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	108,714,149.00	93.39
	其中：股票	108,714,149.00	93.39
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	5,467,188.50	4.70
	其中：债券	5,467,188.50	4.70
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	1,599,501.59	1.37
8	其他各项资产	625,909.21	0.54
9	合计	116,406,748.30	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	980,215.00	0.85
B	采矿业	2,553,940.45	2.21
C	制造业	63,378,424.46	54.86

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,492,775.20	2.16
E	建筑业	1,414,340.34	1.22
F	批发和零售业	6,008,894.64	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	2,253,849.96	1.95
H	住宿和餐饮业	367,640.40	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,224,909.88	10.58
J	金融业	5,496,832.58	4.76
K	房地产业	3,689,167.71	3.19
L	租赁和商务服务业	2,222,108.40	1.92
M	科学研究和技术服务业	788,296.00	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	1,046,755.00	0.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	108,368.64	0.09
Q	卫生和社会工作	795,330.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	1,713,813.88	1.48
S	综合	937,954.20	0.81
	合计	108,473,616.74	93.89

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	78.40	0.00
C	制造业	112,158.37	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	115,529.17	0.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	240,532.26	0.21

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300253	卫宁健康	37,700	864,838.00	0.75
2	002127	南极电商	38,100	806,577.00	0.70

3	002821	凯莱英	3,100	753,300.00	0.65
4	600201	生物股份	25,000	696,000.00	0.60
5	002185	华天科技	48,500	656,205.00	0.57
6	600739	辽宁成大	34,000	643,620.00	0.56
7	300558	贝达药业	4,400	615,912.00	0.53
8	002439	启明星辰	14,597	614,095.79	0.53
9	600529	山东药玻	10,500	609,000.00	0.53
10	300088	长信科技	54,000	604,800.00	0.52
11	002385	大北农	64,900	591,239.00	0.51
12	300012	华测检测	29,600	584,896.00	0.51
13	002131	利欧股份	149,500	577,070.00	0.50
14	300285	国瓷材料	17,200	576,372.00	0.50
15	600079	人福医药	21,100	574,342.00	0.50
16	600521	华海药业	16,230	550,683.90	0.48
17	603444	吉比特	1,000	549,010.00	0.48
18	600298	安琪酵母	11,000	544,280.00	0.47
19	600161	天坛生物	11,660	528,547.80	0.46
20	002465	海格通信	40,800	527,952.00	0.46
21	600143	金发科技	39,800	524,166.00	0.45
22	002075	沙钢股份	39,000	487,500.00	0.42
23	000009	中国宝安	57,120	486,091.20	0.42
24	002223	鱼跃医疗	13,350	485,940.00	0.42
25	601099	太平洋	150,900	478,353.00	0.41
26	002212	南洋股份	17,964	477,483.12	0.41
27	300496	中科创达	6,132	476,456.40	0.41
28	603517	绝味食品	6,720	475,372.80	0.41
29	002074	国轩高科	17,500	469,700.00	0.41
30	300482	万孚生物	4,500	468,000.00	0.41
31	300595	欧普康视	6,700	464,578.00	0.40
32	000636	风华高科	15,900	464,121.00	0.40
33	002273	水晶光电	26,998	462,745.72	0.40

34	300207	欣旺达	24,300	459,270.00	0.40
35	603882	金域医学	5,100	456,450.00	0.40
36	300418	昆仑万维	18,100	451,776.00	0.39
37	300315	掌趣科技	61,000	447,130.00	0.39
38	600426	华鲁恒升	25,214	445,783.52	0.39
39	002507	涪陵榨菜	12,300	442,923.00	0.38
40	000988	华工科技	17,800	434,854.00	0.38
41	300357	我武生物	6,900	429,525.00	0.37
42	603939	益丰药房	4,660	424,060.00	0.37
43	002340	格林美	84,700	420,959.00	0.36
44	002414	高德红外	14,250	417,240.00	0.36
45	000975	银泰黄金	26,500	415,520.00	0.36
46	002603	以岭药业	13,300	414,827.00	0.36
47	300212	易华录	7,300	408,800.00	0.35
48	300168	万达信息	18,400	406,088.00	0.35
49	300271	华宇软件	14,370	405,377.70	0.35
50	600885	宏发股份	10,000	401,200.00	0.35
51	002373	千方科技	16,600	398,234.00	0.34
52	002353	杰瑞股份	12,800	396,800.00	0.34
53	600132	重庆啤酒	5,400	394,200.00	0.34
54	601799	星宇股份	3,100	393,700.00	0.34
55	000513	丽珠集团	8,200	393,682.00	0.34
56	600699	均胜电子	16,440	391,436.40	0.34
57	000547	航天发展	28,581	390,702.27	0.34
58	002156	通富微电	15,300	383,265.00	0.33
59	300009	安科生物	21,130	378,227.00	0.33
60	002797	第一创业	54,600	377,832.00	0.33
61	300024	机器人	27,600	377,292.00	0.33
62	002019	亿帆医药	16,400	376,708.00	0.33
63	002030	达安基因	13,624	371,662.72	0.32
64	000750	国海证券	84,300	365,862.00	0.32

65	300017	网宿科技	43,000	365,070.00	0.32
66	603858	步长制药	12,600	363,510.00	0.31
67	002174	游族网络	13,900	362,512.00	0.31
68	002557	洽洽食品	6,652	360,471.88	0.31
69	600859	王府井	7,900	359,845.00	0.31
70	002138	顺络电子	14,400	359,280.00	0.31
71	600315	上海家化	7,500	359,250.00	0.31
72	000021	深科技	16,400	358,012.00	0.31
73	600801	华新水泥	15,060	357,072.60	0.31
74	002195	二三四五	126,750	356,167.50	0.31
75	002250	联化科技	16,300	355,340.00	0.31
76	300316	晶盛机电	14,300	353,782.00	0.31
77	603233	大参林	4,344	352,819.68	0.31
78	000050	深天马 A	22,900	351,744.00	0.30
79	600380	健康元	21,500	349,160.00	0.30
80	600895	张江高科	17,100	348,327.00	0.30
81	002152	广电运通	26,800	346,792.00	0.30
82	300058	蓝色光标	44,400	346,320.00	0.30
83	002572	索菲亚	14,125	341,401.25	0.30
84	300070	碧水源	42,000	341,040.00	0.30
85	000998	隆平高科	20,400	339,660.00	0.29
86	300244	迪安诊断	9,600	338,880.00	0.29
87	600486	扬农化工	4,100	338,250.00	0.29
88	600845	宝信软件	5,700	336,756.00	0.29
89	000401	冀东水泥	20,900	335,236.00	0.29
90	600667	太极实业	28,000	330,960.00	0.29
91	600410	华胜天成	24,324	330,806.40	0.29
92	002078	太阳纸业	34,500	328,440.00	0.28
93	600037	歌华有线	21,510	326,952.00	0.28
94	300274	阳光电源	22,700	326,653.00	0.28
95	600535	天士力	20,100	326,022.00	0.28

96	002511	中顺洁柔	14,600	325,580.00	0.28
97	600155	华创阳安	27,147	325,492.53	0.28
98	603338	浙江鼎力	4,280	324,295.60	0.28
99	000623	吉林敖东	20,518	322,748.14	0.28
100	600642	申能股份	54,300	320,913.00	0.28
101	002382	蓝帆医疗	10,600	319,166.00	0.28
102	002396	星网锐捷	9,000	317,970.00	0.28
103	002690	美亚光电	6,001	315,652.60	0.27
104	002013	中航机电	39,949	315,597.10	0.27
105	000630	铜陵有色	162,900	314,397.00	0.27
106	601233	桐昆股份	24,500	312,620.00	0.27
107	600126	杭钢股份	30,000	312,000.00	0.27
108	603707	健友股份	4,800	309,936.00	0.27
109	600879	航天电子	48,100	309,764.00	0.27
110	002926	华西证券	29,100	309,333.00	0.27
111	600153	建发股份	37,700	305,370.00	0.26
112	000739	普洛药业	13,100	305,099.00	0.26
113	300010	立思辰	15,400	301,378.00	0.26
114	603659	璞泰来	2,900	298,758.00	0.26
115	600884	杉杉股份	25,230	297,461.70	0.26
116	002281	光迅科技	9,000	295,740.00	0.26
117	600415	小商品城	60,300	293,661.00	0.25
118	600811	东方集团	66,400	293,488.00	0.25
119	600167	联美控股	20,200	289,668.00	0.25
120	001914	招商积余	9,400	288,862.00	0.25
121	600216	浙江医药	14,900	286,974.00	0.25
122	600804	鹏博士	31,653	284,243.94	0.25
123	300251	光线传媒	26,000	283,660.00	0.25
124	600728	佳都科技	30,900	281,499.00	0.24
125	002268	卫 士 通	13,100	279,554.00	0.24
126	300115	长盈精密	12,100	276,485.00	0.24

127	300001	特锐德	13,200	276,408.00	0.24
128	002294	信立泰	9,300	275,838.00	0.24
129	002028	思源电气	13,400	274,164.00	0.24
130	600909	华安证券	40,100	273,883.00	0.24
131	600511	国药股份	6,700	272,489.00	0.24
132	600779	水井坊	4,300	268,406.00	0.23
133	300002	神州泰岳	43,300	268,027.00	0.23
134	000581	威孚高科	12,900	266,772.00	0.23
135	002807	江阴银行	67,820	266,532.60	0.23
136	600325	华发股份	37,400	264,044.00	0.23
137	002387	维信诺	18,412	262,923.36	0.23
138	000686	东北证券	31,050	262,372.50	0.23
139	000997	新大陆	16,350	261,273.00	0.23
140	600528	中铁工业	29,500	260,190.00	0.23
141	603883	老百姓	2,600	260,104.00	0.23
142	601689	拓普集团	9,285	259,051.50	0.22
143	600446	金证股份	13,300	258,020.00	0.22
144	600827	百联股份	17,715	255,981.75	0.22
145	600460	士兰微	17,400	255,432.00	0.22
146	600598	北大荒	15,800	254,380.00	0.22
147	002242	九阳股份	6,779	252,653.33	0.22
148	000999	华润三九	8,600	251,034.00	0.22
149	601860	紫金银行	59,000	249,570.00	0.22
150	600959	江苏有线	66,300	249,288.00	0.22
151	600733	北汽蓝谷	38,600	248,198.00	0.21
152	002317	众生药业	14,400	247,104.00	0.21
153	002500	山西证券	37,500	245,250.00	0.21
154	601168	西部矿业	42,200	244,760.00	0.21
155	600256	广汇能源	90,200	243,540.00	0.21
156	002839	张家港行	42,200	243,072.00	0.21
157	603000	人民网	12,200	241,926.00	0.21

158	002368	太极股份	5,500	240,295.00	0.21
159	603806	福斯特	4,800	239,568.00	0.21
160	600260	凯乐科技	17,700	239,304.00	0.21
161	300296	利亚德	39,400	239,158.00	0.21
162	000564	供销大集	53,200	238,868.00	0.21
163	000878	云南铜业	22,509	238,820.49	0.21
164	600820	隧道股份	42,100	237,865.00	0.21
165	600704	物产中大	56,000	235,760.00	0.20
166	600839	四川长虹	81,829	234,849.23	0.20
167	300166	东方国信	18,900	234,549.00	0.20
168	002670	国盛金控	25,600	234,240.00	0.20
169	603605	珀莱雅	1,300	234,026.00	0.20
170	300113	顺网科技	9,200	233,680.00	0.20
171	002081	金螳螂	29,700	233,442.00	0.20
172	002124	天邦股份	18,100	232,585.00	0.20
173	600497	驰宏锌锗	67,600	232,544.00	0.20
174	600418	江淮汽车	26,200	231,346.00	0.20
175	002080	中材科技	14,900	230,950.00	0.20
176	600673	东阳光	33,300	230,103.00	0.20
177	300630	普利制药	3,100	229,245.00	0.20
178	600572	康恩贝	41,400	227,700.00	0.20
179	600008	首创股份	75,500	227,255.00	0.20
180	002221	东华能源	25,800	226,782.00	0.20
181	600549	厦门钨业	18,900	223,776.00	0.19
182	300618	寒锐钴业	3,600	223,272.00	0.19
183	000158	常山北明	21,300	222,372.00	0.19
184	603866	桃李面包	4,360	221,880.40	0.19
185	000800	一汽解放	20,600	221,244.00	0.19
186	600718	东软集团	19,200	220,800.00	0.19
187	002920	德赛西威	3,600	220,788.00	0.19
188	300026	红日药业	39,950	220,524.00	0.19

189	002936	郑州银行	64,020	220,228.80	0.19
190	601179	中国西电	45,300	219,252.00	0.19
191	002217	合力泰	41,500	217,875.00	0.19
192	600875	东方电气	24,600	217,710.00	0.19
193	600171	上海贝岭	12,500	217,250.00	0.19
194	601966	玲珑轮胎	10,752	217,190.40	0.19
195	600908	无锡银行	43,900	215,549.00	0.19
196	600021	上海电力	29,000	214,600.00	0.19
197	002831	裕同科技	7,789	214,275.39	0.19
198	000729	燕京啤酒	31,200	213,720.00	0.18
199	600060	海信视像	17,400	211,410.00	0.18
200	000877	天山股份	13,900	209,890.00	0.18
201	600862	中航高科	12,400	209,808.00	0.18
202	600567	山鹰纸业	71,100	209,745.00	0.18
203	600094	大名城	35,244	209,701.80	0.18
204	002399	海普瑞	8,371	209,609.84	0.18
205	002709	天赐材料	6,200	209,498.00	0.18
206	000060	中金岭南	55,800	207,576.00	0.18
207	002056	横店东磁	18,400	207,000.00	0.18
208	600160	巨化股份	29,841	205,604.49	0.18
209	600645	中源协和	7,200	203,400.00	0.18
210	603228	景旺电子	5,747	202,236.93	0.18
211	600597	光明乳业	13,600	202,096.00	0.17
212	002458	益生股份	13,100	200,037.00	0.17
213	000090	天健集团	28,942	199,989.22	0.17
214	300133	华策影视	27,580	199,955.00	0.17
215	600754	锦江酒店	7,200	199,800.00	0.17
216	002429	兆驰股份	40,100	198,495.00	0.17
217	600026	中远海能	30,700	198,322.00	0.17
218	600967	内蒙一机	18,900	196,371.00	0.17
219	603712	七一二	5,100	195,738.00	0.17

220	603568	伟明环保	8,420	195,344.00	0.17
221	600273	嘉化能源	22,200	194,028.00	0.17
222	601005	重庆钢铁	129,900	193,551.00	0.17
223	600580	卧龙电驱	17,200	193,328.00	0.17
224	002233	塔牌集团	16,000	192,480.00	0.17
225	002648	卫星石化	11,800	191,986.00	0.17
226	600392	盛和资源	27,200	191,760.00	0.17
227	000629	攀钢钒钛	94,900	190,749.00	0.17
228	600282	南钢股份	59,000	190,570.00	0.16
229	000960	锡业股份	22,200	190,032.00	0.16
230	600039	四川路桥	49,700	189,854.00	0.16
231	002085	万丰奥威	29,200	189,216.00	0.16
232	002203	海亮股份	21,607	189,061.25	0.16
233	002004	华邦健康	35,100	188,838.00	0.16
234	600755	厦门国贸	28,600	188,760.00	0.16
235	601118	海南橡胶	38,300	186,138.00	0.16
236	600563	法拉电子	3,007	185,832.60	0.16
237	600064	南京高科	19,100	185,652.00	0.16
238	000598	兴蓉环境	40,200	184,920.00	0.16
239	000970	中科三环	18,900	184,842.00	0.16
240	601975	招商南油	77,300	184,747.00	0.16
241	600195	中牧股份	11,380	184,697.40	0.16
242	600737	中粮糖业	23,600	183,608.00	0.16
242	000690	宝新能源	38,900	183,608.00	0.16
244	600566	济川药业	7,200	183,312.00	0.16
245	600166	福田汽车	101,800	183,240.00	0.16
246	000778	新兴铸管	53,100	182,133.00	0.16
247	300182	捷成股份	45,605	181,963.95	0.16
248	300474	景嘉微	2,700	181,710.00	0.16
249	300324	旋极信息	27,100	180,486.00	0.16
249	002110	三钢闽光	27,100	180,486.00	0.16

251	600881	亚泰集团	61,887	180,091.17	0.16
252	600515	海航基础	34,600	179,920.00	0.16
253	600466	蓝光发展	33,300	179,487.00	0.16
254	603816	顾家家居	3,980	179,139.80	0.16
255	000400	许继电气	13,400	176,880.00	0.15
256	600373	中文传媒	14,994	176,629.32	0.15
257	002506	协鑫集成	67,600	176,436.00	0.15
258	002183	怡亚通	32,840	176,022.40	0.15
259	000402	金融街	26,509	176,019.76	0.15
260	000967	盈峰环境	21,300	175,725.00	0.15
261	002595	豪迈科技	9,000	175,140.00	0.15
262	600435	北方导航	23,102	174,651.12	0.15
263	002635	安洁科技	7,000	174,300.00	0.15
264	002038	双鹭药业	13,600	174,216.00	0.15
265	002745	木林森	11,300	174,133.00	0.15
266	002925	盈趣科技	3,000	173,820.00	0.15
267	002191	劲嘉股份	19,500	173,745.00	0.15
268	000738	航发控制	12,700	173,355.00	0.15
269	000681	视觉中国	9,300	173,166.00	0.15
270	000089	深圳机场	22,600	173,116.00	0.15
271	002048	宁波华翔	11,197	172,881.68	0.15
272	600808	马钢股份	66,800	172,344.00	0.15
273	002092	中泰化学	38,000	172,140.00	0.15
274	600633	浙数文化	17,500	171,150.00	0.15
275	600643	爱建集团	21,500	170,925.00	0.15
276	000930	中粮科技	25,000	170,750.00	0.15
277	000039	中集集团	23,580	170,483.40	0.15
278	601098	中南传媒	16,090	170,232.20	0.15
279	000983	西山煤电	45,370	170,137.50	0.15
280	601106	中国一重	60,500	170,005.00	0.15
281	000825	太钢不锈	51,100	169,652.00	0.15

282	002948	青岛银行	33,200	168,988.00	0.15
283	600729	重庆百货	5,402	168,650.44	0.15
284	600120	浙江东方	24,545	168,624.15	0.15
285	000830	鲁西化工	22,600	168,596.00	0.15
286	601333	广深铁路	74,800	168,300.00	0.15
287	600258	首旅酒店	10,920	167,840.40	0.15
288	600056	中国医药	11,800	166,970.00	0.14
289	600388	龙净环保	18,900	166,320.00	0.14
290	600649	城投控股	27,900	165,726.00	0.14
291	600675	中华企业	40,500	164,835.00	0.14
292	000563	陕国投 A	44,400	164,724.00	0.14
293	000415	渤海租赁	54,800	163,304.00	0.14
294	002372	伟星新材	14,000	162,820.00	0.14
295	601718	际华集团	49,000	162,680.00	0.14
296	601866	中远海发	87,800	161,552.00	0.14
297	300180	华峰超纤	18,800	160,928.00	0.14
298	002407	多氟多	15,100	160,664.00	0.14
299	600776	东方通信	10,600	159,954.00	0.14
300	002815	崇达技术	7,800	157,794.00	0.14
301	002064	华峰氨纶	31,000	157,170.00	0.14
302	002583	海能达	20,700	157,113.00	0.14
303	002640	跨境通	24,200	157,058.00	0.14
304	600376	首开股份	26,800	157,048.00	0.14
305	002010	传化智联	28,800	156,672.00	0.14
306	600022	山东钢铁	121,260	156,425.40	0.14
307	000012	南玻 A	31,048	155,860.96	0.13
308	603077	和邦生物	117,500	155,100.00	0.13
309	600500	中化国际	30,600	154,836.00	0.13
310	601615	明阳智能	12,400	154,380.00	0.13
311	000078	海王生物	36,800	154,192.00	0.13
312	000932	华菱钢铁	40,580	152,986.60	0.13

313	600062	华润双鹤	11,560	152,823.20	0.13
314	000807	云铝股份	35,019	152,682.84	0.13
315	600266	城建发展	30,072	152,465.04	0.13
316	000883	湖北能源	43,100	151,712.00	0.13
317	000959	首钢股份	35,200	151,360.00	0.13
318	002375	亚厦股份	14,800	151,256.00	0.13
319	000685	中山公用	19,600	150,920.00	0.13
320	603486	科沃斯	4,993	150,838.53	0.13
321	600316	洪都航空	9,500	150,100.00	0.13
322	000028	国药一致	3,301	148,578.01	0.13
323	000301	东方盛虹	26,700	148,452.00	0.13
324	601699	潞安环能	26,500	147,605.00	0.13
325	000559	万向钱潮	30,483	147,537.72	0.13
326	002155	湖南黄金	18,648	146,946.24	0.13
327	002244	滨江集团	34,400	146,888.00	0.13
328	601000	唐山港	65,700	146,511.00	0.13
329	000027	深圳能源	31,520	146,252.80	0.13
330	000488	晨鸣纸业	29,500	145,730.00	0.13
331	000519	中兵红箭	15,400	145,068.00	0.13
332	000528	柳 工	22,900	144,499.00	0.13
333	000031	大悦城	28,367	144,388.03	0.12
334	600782	新钢股份	35,200	143,616.00	0.12
335	000987	越秀金控	12,200	142,252.00	0.12
336	002444	巨星科技	11,900	141,372.00	0.12
337	002266	浙富控股	35,900	138,933.00	0.12
338	002440	闰土股份	15,200	138,928.00	0.12
339	002625	光启技术	19,100	138,475.00	0.12
340	600073	上海梅林	14,502	137,623.98	0.12
341	000156	华数传媒	12,700	137,541.00	0.12
342	600777	新潮能源	90,000	136,800.00	0.12
343	601717	郑煤机	23,000	135,470.00	0.12

344	300459	金科文化	39,040	134,688.00	0.12
345	600312	平高电气	18,100	134,302.00	0.12
346	002390	信邦制药	29,400	134,064.00	0.12
347	600291	西水股份	14,700	133,035.00	0.12
348	601958	金钼股份	21,400	132,252.00	0.11
349	601608	中信重工	38,483	131,611.86	0.11
350	002701	奥瑞金	31,200	130,728.00	0.11
351	000898	鞍钢股份	53,200	130,340.00	0.11
352	002424	贵州百灵	15,700	130,310.00	0.11
353	002434	万里扬	15,000	130,200.00	0.11
354	000046	泛海控股	34,400	129,688.00	0.11
355	600557	康缘药业	9,300	129,456.00	0.11
356	000501	鄂武商 A	8,207	128,685.76	0.11
357	000887	中鼎股份	16,270	127,719.50	0.11
358	600409	三友化工	27,400	127,684.00	0.11
359	000758	中色股份	30,400	127,072.00	0.11
360	600765	中航重机	12,400	126,728.00	0.11
361	002505	大康农业	56,300	126,675.00	0.11
362	002589	瑞康医药	23,600	126,496.00	0.11
363	600751	海航科技	40,400	126,452.00	0.11
364	000008	神州高铁	43,000	126,420.00	0.11
365	600138	中青旅	12,800	126,336.00	0.11
366	600863	内蒙华电	51,300	126,198.00	0.11
367	002563	森马服饰	17,800	125,490.00	0.11
368	601228	广州港	41,000	124,640.00	0.11
369	601200	上海环境	10,351	124,212.00	0.11
370	002002	鸿达兴业	34,300	123,823.00	0.11
371	000712	锦龙股份	9,900	123,750.00	0.11
372	600507	方大特钢	23,798	123,511.62	0.11
373	000813	德展健康	19,800	122,760.00	0.11
374	600970	中材国际	23,200	122,496.00	0.11

375	600478	科力远	25,900	121,989.00	0.11
376	600158	中体产业	14,900	121,882.00	0.11
377	600639	浦东金桥	7,601	121,463.98	0.11
378	300134	大富科技	8,600	120,228.00	0.10
379	600835	上海机电	7,100	120,203.00	0.10
380	600259	广晟有色	4,000	120,000.00	0.10
381	600545	卓郎智能	25,100	118,723.00	0.10
382	000826	启迪环境	15,900	117,978.00	0.10
383	600717	天津港	26,688	117,960.96	0.10
384	600648	外高桥	8,300	117,362.00	0.10
385	601880	大连港	68,200	117,304.00	0.10
386	601928	凤凰传媒	17,200	116,960.00	0.10
387	002249	大洋电机	32,000	115,520.00	0.10
388	603198	迎驾贡酒	5,300	115,381.00	0.10
389	601598	中国外运	35,500	114,665.00	0.10
390	600125	铁龙物流	20,500	114,390.00	0.10
391	600823	世茂股份	25,200	112,644.00	0.10
392	000061	农产品	15,000	111,150.00	0.10
393	600329	中新药业	6,400	110,848.00	0.10
394	601611	中国核建	17,900	110,622.00	0.10
395	600348	阳泉煤业	26,100	110,142.00	0.10
396	600640	号百控股	5,500	109,725.00	0.09
397	300376	易事特	21,100	109,720.00	0.09
398	600307	酒钢宏兴	71,000	109,340.00	0.09
399	002665	首航高科	44,700	109,068.00	0.09
400	002867	周大生	4,900	108,633.00	0.09
401	000718	苏宁环球	35,100	108,459.00	0.09
402	603377	东方时尚	6,544	108,368.64	0.09
403	002302	西部建设	11,200	107,520.00	0.09
404	002901	大博医疗	900	107,361.00	0.09
405	600582	天地科技	36,500	106,945.00	0.09

406	000869	张 裕 A	3, 100	105, 865. 00	0. 09
407	600748	上实发展	20, 700	105, 777. 00	0. 09
408	000990	诚志股份	8, 300	105, 327. 00	0. 09
409	600141	兴发集团	11, 700	104, 715. 00	0. 09
410	600901	江苏租赁	20, 000	104, 200. 00	0. 09
411	002544	杰赛科技	7, 900	103, 885. 00	0. 09
412	000543	皖能电力	25, 800	103, 716. 00	0. 09
413	600017	日照港	41, 600	103, 584. 00	0. 09
414	000062	深圳华强	7, 080	102, 943. 20	0. 09
415	603888	新华网	4, 600	102, 856. 00	0. 09
416	300072	三聚环保	23, 904	102, 309. 12	0. 09
417	600664	哈药股份	33, 200	102, 256. 00	0. 09
418	300257	开山股份	7, 800	101, 946. 00	0. 09
419	002093	国脉科技	11, 499	101, 766. 15	0. 09
420	600277	亿利洁能	31, 200	101, 712. 00	0. 09
421	000717	韶钢松山	26, 700	101, 460. 00	0. 09
422	002419	天虹股份	10, 619	101, 411. 45	0. 09
423	002128	露天煤业	13, 080	101, 370. 00	0. 09
424	002416	爱施德	14, 080	101, 094. 40	0. 09
425	601678	滨化股份	23, 800	100, 912. 00	0. 09
426	002408	齐翔腾达	16, 100	99, 981. 00	0. 09
427	000848	承德露露	14, 200	99, 400. 00	0. 09
428	600869	智慧能源	24, 500	98, 000. 00	0. 08
429	002653	海思科	3, 600	95, 796. 00	0. 08
430	603515	欧普照明	3, 500	95, 795. 00	0. 08
431	603328	依顿电子	9, 119	95, 111. 17	0. 08
432	600565	迪马股份	33, 300	92, 907. 00	0. 08
433	300197	铁汉生态	36, 400	92, 456. 00	0. 08
434	000537	广宇发展	12, 640	92, 272. 00	0. 08
435	000553	安道麦A	10, 100	91, 102. 00	0. 08
436	603650	彤程新材	3, 900	90, 753. 00	0. 08

437	603766	隆鑫通用	23,400	90,558.00	0.08
438	601019	山东出版	14,300	89,375.00	0.08
439	603885	吉祥航空	9,700	88,270.00	0.08
440	002503	搜于特	31,400	88,234.00	0.08
441	002491	通鼎互联	17,100	87,552.00	0.08
442	600787	中储股份	19,900	87,361.00	0.08
443	603056	德邦股份	6,400	86,592.00	0.07
444	600053	九鼎投资	2,900	86,536.00	0.07
445	601869	长飞光纤	2,800	86,268.00	0.07
446	600339	中油工程	38,000	86,260.00	0.07
447	603983	丸美股份	1,000	86,030.00	0.07
448	601139	深圳燃气	13,100	85,150.00	0.07
449	600770	综艺股份	17,700	84,960.00	0.07
450	600350	山东高速	13,800	84,732.00	0.07
451	002470	金正大	37,238	84,530.26	0.07
452	600657	信达地产	19,800	81,576.00	0.07
453	000600	建投能源	16,000	81,440.00	0.07
454	002051	中工国际	11,179	81,383.12	0.07
455	600338	西藏珠峰	8,060	80,600.00	0.07
456	603317	天味食品	1,440	80,035.20	0.07
457	601016	节能风电	37,700	79,924.00	0.07
458	002118	紫鑫药业	17,600	78,144.00	0.07
459	600694	大商股份	3,200	76,768.00	0.07
460	600985	淮北矿业	9,849	76,723.71	0.07
461	601801	皖新传媒	13,601	75,621.56	0.07
462	603786	科博达	1,000	75,350.00	0.07
463	002285	世联行	26,890	75,023.10	0.06
464	600707	彩虹股份	16,300	74,328.00	0.06
465	600575	淮河能源	35,500	74,195.00	0.06
466	000937	冀中能源	24,200	73,084.00	0.06
467	600006	东风汽车	18,100	72,943.00	0.06

468	600428	中远海特	23,600	72,688.00	0.06
469	600757	长江传媒	13,765	70,063.85	0.06
470	601865	福莱特	3,600	67,680.00	0.06
471	600996	贵广网络	9,300	66,309.00	0.06
472	600874	创业环保	9,900	65,736.00	0.06
473	600623	华谊集团	12,685	65,454.60	0.06
474	603556	海兴电力	4,500	64,980.00	0.06
475	002941	新疆交建	4,300	60,845.00	0.05
476	600058	五矿发展	9,500	57,380.00	0.05
477	603868	飞科电器	1,100	54,263.00	0.05
478	601003	柳钢股份	12,100	53,603.00	0.05
479	000785	居然之家	6,700	53,064.00	0.05
480	600903	贵州燃气	5,160	50,774.40	0.04
481	000025	特力A	2,715	49,765.95	0.04
482	002946	新乳业	2,800	48,580.00	0.04
483	601127	小康股份	5,800	48,198.00	0.04
484	603355	莱克电气	1,900	47,291.00	0.04
485	600335	国机汽车	9,900	45,738.00	0.04
486	601969	海南矿业	9,300	45,384.00	0.04
487	002818	富森美	3,420	42,066.00	0.04
488	603379	三美股份	1,920	41,222.40	0.04
489	601811	新华文轩	3,800	38,646.00	0.03
490	603225	新凤鸣	3,820	38,123.60	0.03
491	002423	中粮资本	4,200	36,540.00	0.03
492	001872	招商港口	2,400	34,920.00	0.03
493	603025	大豪科技	4,200	30,534.00	0.03
494	600917	重庆燃气	4,200	29,988.00	0.03
495	601068	中铝国际	6,800	26,588.00	0.02
496	603256	宏和科技	2,200	25,168.00	0.02
497	002957	科瑞技术	900	21,510.00	0.02
498	601512	中新集团	1,200	13,800.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688228	开普云	1,413	103,431.60	0.09
2	603087	甘李药业	365	36,609.50	0.03
3	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.02
4	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
5	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
6	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
7	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
8	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
9	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
10	300014	亿纬锂能	82	3,923.70	0.00
11	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
12	601001	大同煤业	20	78.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002185	华天科技	1,333,952.00	0.74
2	300558	贝达药业	1,003,950.00	0.56
3	600529	山东药玻	955,675.00	0.53
4	300357	我武生物	849,413.00	0.47
5	300271	华宇软件	790,896.00	0.44
6	300212	易华录	775,335.00	0.43

7	300482	万孚生物	770,548.00	0.43
8	300017	网宿科技	740,389.00	0.41
9	300496	中科创达	735,454.20	0.41
10	002557	洽洽食品	716,097.73	0.40
11	300595	欧普康视	708,549.00	0.39
12	300024	机器人	706,905.00	0.39
13	002138	顺络电子	704,067.00	0.39
14	300070	碧水源	695,020.00	0.39
15	002156	通富微电	687,007.00	0.38
16	600153	建发股份	627,171.00	0.35
17	002396	星网锐捷	625,808.00	0.35
18	002511	中顺洁柔	613,027.00	0.34
19	600535	天士力	606,729.00	0.34
20	000630	铜陵有色	595,101.00	0.33

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600745	闻泰科技	1,705,018.00	0.95
2	300014	亿纬锂能	1,681,403.00	0.93
3	002371	北方华创	1,570,903.00	0.87
4	002463	沪电股份	1,525,918.04	0.85
5	002049	紫光国微	1,452,768.00	0.81
6	300383	光环新网	1,426,393.00	0.79
7	600584	长电科技	1,355,550.00	0.75
8	002384	东山精密	1,347,562.00	0.75
9	600763	通策医疗	1,287,517.00	0.72
10	002129	中环股份	1,286,358.00	0.71
11	300529	健帆生物	1,207,431.60	0.67

12	002812	恩捷股份	1,159,092.00	0.64
13	000066	中国长城	1,158,837.00	0.64
14	002065	东华软件	1,157,071.00	0.64
15	600536	中国软件	1,014,113.00	0.56
16	002180	纳思达	913,878.00	0.51
17	300253	卫宁健康	883,207.00	0.49
18	601100	恒立液压	838,578.00	0.47
19	002821	凯莱英	777,331.00	0.43
20	002439	启明星辰	744,301.00	0.41

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	61,701,462.52
卖出股票收入（成交）总额	139,838,290.80

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	5,467,188.50	4.73
	其中：政策性金融债	5,467,188.50	4.73
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,467,188.50	4.73

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	018007	国开1801	54,590	5,467,188.50	4.73

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	33,578.12

2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	174,643.00
5	应收申购款	417,688.09
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	625,909.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688228	开普云	103,431.60	0.09	—

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有	户均持有的基金份	持有人结构
----	----------	-------

人户 数 (户)	额	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
6,040	13,883.66	63,581,581.62	75.820%	20,275,700.30	24.180%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	49,091.55	0.060%

8.3 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情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年12月07日)基金份额总额	255,386,460.94
本报告期期初基金份额总额	148,511,296.02
本报告期基金总申购份额	37,767,689.68
减：本报告期基金总赎回份额	102,421,703.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	83,857,281.92

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自成立之日起至今聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务,本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	30,718,341.74	15.46%	22,464.62	15.46%	-
光大证券	1	39,460,909.19	19.86%	28,857.49	19.86%	-
海通证券	1	35,845,593.03	18.04%	26,214.35	18.04%	-
兴业	1	11,057,270.76	5.57%	8,086.41	5.57%	-

证券						
招商证券	1	73,303,164.24	36.89%	53,607.01	36.89%	-
中信建投	1	8,298,372.04	4.18%	6,068.70	4.18%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 基本情况：包括但不限于资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；主要股东实力强大；具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合进行证券交易的需要，并能为投资组合提供全面的信息服务；
- (2) 公司治理：公司治理完善，股东会、董事会、监事会及管理层权责明确，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；
- (3) 研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能在符合相关法规及执业规范的前提下，根据公司的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强风险意识和风险测算能力；

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期无新增交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,264,866.50	17.94%	-	-	-	-	-	-
光大证券	1,167,524.00	16.56%	-	-	-	-	-	-
海通证	3,982,830.69	56.48%	-	-	-	-	-	-

券								
兴业证 券	352,905.00	5.00%	-	-	-	-	-	-
招商证 券	283,481.12	4.02%	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-02
2	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金开展直销渠道赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-18
3	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金在中国银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-03
4	中国人保资产管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
5	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金开展网上直销费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-31
6	人保中证500指数型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-07
7	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金在北京汇成基金销售有限公司开通定投并参与费率优惠活动的公	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-08

	告		
8	人保中证500指数型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-08
9	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金在北京蛋卷基金销售有限公司开通定投并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-08
10	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书更新的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
11	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同、托管协议的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
12	中国人保资产管理有限公司旗下基金2020年1季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
13	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金在江苏汇林保大基金销售有限公司开通定投并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-28
14	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金在北京百度百盈基金销售有限公司开通定投并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

资 者 类 别	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	20200220-20200303, 20200305-20200630	25,836,706.57	-	-	25,836,706.57	30.81%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。 当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予人保中证500指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《人保中证500指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《人保中证500指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内人保中证500指数型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区西长安街88号中国人保大厦

基金托管人办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址: fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

二〇二〇年八月三十一日