

人保中证 500 指数型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:2024 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2024年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024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	7
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
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	40
7.3 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	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	60
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 本基金投资股指期货的投资政策	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	64
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	53,869,837.70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	郭乐琦	方圆
	联系电话	021-38572076	95559
	电子邮箱	guolq@piccamc.com	fangy_20@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道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		100031	200336
法定代表人		黄本尧	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	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

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道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

§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 (2024年01月01日-2024年06月30日)
本期已实现收益	-254,977.65
本期利润	-5,573,381.69
加权平均基金份额本期利润	-0.1755
本期加权平均净值利润率	-13.22%
本期基金份额净值增长率	-7.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	14,418,406.52
期末可供分配基金份额利润	0.2677
期末基金资产净值	68,288,244.22
期末基金份额净值	1.2677
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	26.77%

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

2、期末可供分配利润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	-5.80%	0.90%	-6.55%	0.91%	0.75%	-0.01%
过去三个月	-5.10%	1.07%	-6.16%	1.09%	1.06%	-0.02%
过去六个月	-7.64%	1.51%	-8.46%	1.53%	0.82%	-0.02%
过去一年	-15.58%	1.19%	-16.71%	1.21%	1.13%	-0.02%
过去三年	-22.13%	1.11%	-26.01%	1.14%	3.88%	-0.03%
自基金合同生效起至今	26.77%	1.22%	12.15%	1.25%	14.62%	-0.03%

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

人保中证500累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年12月07日-2024年06月30日)



- 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，建仓期结束，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（以下简称人保资产）成立于2003年7月16日，是经国务院同意、原保监会批准设立的境内第一家保险资产管理公司，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。目前管理资产1.7万亿元人民币，

具备原银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、衍生品运用能力和信托产品投资能力，具有国家外汇管理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。

成立二十年来，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。

二十年来，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业务，并积极创新和开展股权投资、基础设施债权投资、资产管理产品等业务，积极开展公募基金业务，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；二十年来，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。

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2024年6月30日，本公司旗下基金产品线逐渐丰富，涵盖了股票指数型、债券型、混合型、货币型产品，管理的基金产品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、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、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、人保行业轮动混合型证券投资基金、人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金、人保利丰纯债债券型证券投资基金、人保安睿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保安和一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保民富债券型证券投资基金、人保中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、人保民享利率债债券型证券投资基金、人保泰睿积极配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）等。

心有所向，路必不远。面向未来，人保资产将深刻理解和把握服务中国式现代化的“人保坐标”，深入贯彻落实人保集团卓越战略，踔厉奋发，奋力开创人保资产高质量发展的新局面，谱写新时代卓越保险资产管理公司的新篇章！

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		
周剑	基金经理	2023-07-13	-	7.5年	华东理工大学金融学硕士，曾在中欧基金管理有限公司担任量化分析师、研究助理、研究员。2023年1月加入人保资产公募基金事业部，自2023年7月13日起任人保中证500指数型证券投资基金基金经理、2023年9月15日起担任人保沪深300指数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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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) 指数成份股的调整；4) 指数成份股的停牌。

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1.2677元，本报告期内，基金份额净值增长率为-7.64%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年上半年，我国经济实现5%的增长，为完成全年5%左右的经济增长目标奠定了基础。或许国内经济面临的真正挑战来自明年，且短期人民币汇率受中美利差扩大而承压，因此上半年来，国内财政、货币两端均保持相对克制。

上半年，我们看到一些国内经济较为积极的部分，如出口表现较为亮眼，一线城市地产限制政策在四月政治局会议后得到快速松绑等；但也不能忽视经济的内在隐忧，如通胀疲弱，实体信贷需求差，房地产数据滑坡等。

6月加拿大央行、欧央行、瑞士央行等先后落地降息操作，海外流行性转好的预期逐步兑现，海外经济体证券市场普涨。相较于海外，A股上半年表现不尽如人意，上证指数几度失守3000点，小盘股受资金去杠杆、打击量化、规范退市等影响回调幅度较大，红利板块则在低风险偏好资金推动下表现出色。

站在当前点位，我们看到影响A股市场的风险已得到一定释放，估值回落带来股市投资性价比逐步提升。伴随美国通胀回落与就业市场压力回升，市场不断修正对美联储的降息预期，从目前来看，美国最早或于Q3迎来首次降息，届时人民币汇率承压局面或将有所改观，国内货币政策空间或也将得以打开。

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。会计师事务所管理人在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相关领导、投研、交易、合规风控及运营等部门人员组成，以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。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债金融估值中心有限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、流通受限股票等的估值数据。

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

本报告期内，因赎回等原因，本基金自2024年1月2日至2024年5月17日连续88个工作日净值低于5000万。本报告期内本基金未出现连续20个工作日基金持有人数不满二百人的情形。

§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，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

本报告期内，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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（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：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	564,053.68	446,119.90
结算备付金		308,919.81	16,054.03
存出保证金		9,059.62	23,191.81
交易性金融资产	6.4.7.2	67,161,019.02	34,702,673.03
其中：股票投资		63,716,880.41	32,890,653.77
基金投资		-	-
债券投资		3,444,138.61	1,812,019.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	400,000.00	200,000.00
应收清算款		87.12	-
应收股利		-	-

应收申购款		20,603.28	35,494.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		68,463,742.53	35,423,533.22
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	200,000.00
应付赎回款		24,557.29	59,036.03
应付管理人报酬		26,178.65	13,439.17
应付托管费		5,817.48	2,986.48
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		32.45	10.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	118,912.44	67,874.71
负债合计		175,498.31	343,346.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	53,869,837.70	25,558,786.18
未分配利润	6.4.7.8	14,418,406.52	9,521,400.56
净资产合计		68,288,244.22	35,080,186.74
负债和净资产总计		68,463,742.53	35,423,533.22

注：报告截止日2023年12月31日，人保中证500份额净值人民币1.3725元，基金份额总额25,558,786.18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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-5,328,556.08	2,723,774.46
1.利息收入		4,370.63	14,036.49
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,551.59	14,036.49
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		1,819.04	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-16,256.73	656,005.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-820,983.95	257,762.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	16,613.04	-1,405.36
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	788,114.18	399,648.65
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,318,404.04	1,998,932.01
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	1,734.06	54,800.51

减：二、营业总支出		244,825.61	258,156.95
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	93,449.25	103,927.83
2.托管费	6.4.10.2.2	20,766.47	23,095.07
3.销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		168.09	-
其中：卖出回购金融资产支出		168.09	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		6.54	-
8.其他费用	6.4.7.19	130,435.26	131,134.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,573,381.69	2,465,617.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,573,381.69	2,465,617.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,573,381.69	2,465,617.51

6.3 净资产变动表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	25,558,786.18	9,521,400.56	35,080,186.74
二、本期期初净资产	25,558,786.18	9,521,400.56	35,080,186.74
三、本期增减变动	28,311,051.52	4,897,005.96	33,208,057.48

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	-5,573,381.69	-5,573,381.69
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	28,311,051.52	10,470,387.65	38,781,439.17
其中：1.基金申购款	31,782,227.44	11,557,733.63	43,339,961.07
2.基金赎回款	-3,471,175.92	-1,087,345.98	-4,558,521.90
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	53,869,837.70	14,418,406.52	68,288,244.22
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	29,433,072.77	13,265,730.28	42,698,803.05
二、本期期初净资产	29,433,072.77	13,265,730.28	42,698,803.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,256,627.53	-135,935.93	-3,392,563.46
（一）、综合收益总额	-	2,465,617.51	2,465,617.51
（二）、本期基金份额交易产生的净	-3,256,627.53	-2,601,553.44	-5,858,180.97

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	28,377,466.06	14,502,291.34	42,879,757.40
2.基金赎回款	-31,634,093.59	-17,103,844.78	-48,737,938.37
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	26,176,445.24	13,129,794.35	39,306,239.59

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：

黄明

贾鸣

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号的验资报告。基金合同于2018年12月7日正式生效。本基金的管理人为中国人保资产管理有限公司，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，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）。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、存托凭证）、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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：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》、应用指南、解释及其他相关规定，并参照中国证监会发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》等基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本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要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要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要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关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；2018年1月1日起，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，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，受让方不再缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
活期存款	564,053.68	
等于：本金	564,005.88	
加：应计利息	47.80	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	564,053.68	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	71,974,452.91	-	63,716,880.41	-8,257,572.50	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,407,425.48	29,918.61	3,444,138.61	6,794.52
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,407,425.48	29,918.61	3,444,138.61	6,794.52

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	75,381,878.39	29,918.61	67,161,019.02	-8,250,777.98

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	400,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无因买断式逆回购交易而取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.13
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	39,075.05

其中：交易所市场	39,075.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	29,835.26
其他应付	50,000.00
合计	118,912.44

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,558,786.18	25,558,786.18
本期申购	31,782,227.44	31,782,227.44
本期赎回（以“-”号填列）	-3,471,175.92	-3,471,175.92
本期末	53,869,837.70	53,869,837.70

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	27,674,290.20	-18,152,889.64	9,521,400.56
本期期初	27,674,290.20	-18,152,889.64	9,521,400.56
本期利润	-254,977.65	-5,318,404.04	-5,573,381.69
本期基金份额交易产生的变动数	30,424,388.57	-19,954,000.92	10,470,387.65
其中：基金申购款	34,165,136.32	-22,607,402.69	11,557,733.63
基金赎回款	-3,740,747.75	2,653,401.77	-1,087,345.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,843,701.12	-43,425,294.60	14,418,406.52

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	2,049.48
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	407.08
其他	95.03
合计	2,551.59

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	8,241,410.99
减：卖出股票成本总额	9,015,015.99
减：交易费用	47,378.95
买卖股票差价收入	-820,983.95

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	15,158.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,454.26
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	16,613.04

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	406,509.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	400,959.52
减：应计利息总额	4,096.05
减：交易费用	0.11
买卖债券差价收入	1,454.26

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	788,114.18
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	788,114.18

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-5,318,404.04
——股票投资	-5,321,203.56
——债券投资	2,799.52
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,318,404.04

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	1,730.27
转换费收入	3.79
合计	1,734.06

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	4,972.24

信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
汇划手续费	600.00
其他费用_指数使用费	100,000.00
合计	130,435.26

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内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已经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无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无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无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无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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均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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	93,449.25	103,927.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	34,117.95	38,366.84
应支付基金管理人的净管理费	59,331.30	65,560.99

注：支付基金管理人中国人保资产管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.45%的年费率计提，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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	20,766.47	23,095.07

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司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自有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国人民健康保险股份有限公司	22,024,800.75	40.89%	0.00	0.00%

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		上年度可比期间	
	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023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	564,053.68	2,049.48	3,055,112.29	13,437.85

注：本基金由基金托管人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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型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（2024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：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	N升24转	2024-06-14	18个交易日	新债未上市	100.00	100.01	130	13,000.00	13,000.97	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	*ST中天	2023-05-19	已退市	-	-	-	27,500	55,512.90	-	-

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。公募基金事业部部务会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；董事会下设风险管理与消费者权益保护委员会、监事会、总裁室下设风险合规委员会、风险管理部、法律合规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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-

AAA以下	13,000.97	2,600.08
未评级	-	-
合计	13,000.97	2,600.08

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 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	564,053.68	-	-	-	564,053.68
结算备付金	308,919.81	-	-	-	308,919.81
存出保证金	9,059.62	-	-	-	9,059.62
交易性金融资产	3,444,138.61	-	-	63,716,880.41	67,161,019.02
买入返售金融资产	400,000.00	-	-	-	400,000.00
应收清算款	-	-	-	87.12	87.12
应收申购款	-	-	-	20,603.28	20,603.28
资产总计	4,726,171.72	-	-	63,737,570.81	68,463,742.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,557.29	24,557.29
应付管理人报	-	-	-	26,178.65	26,178.65

酬					
应付托管费	-	-	-	5,817.48	5,817.48
应交税费	-	-	-	32.45	32.45
其他负债	-	-	-	118,912.44	118,912.44
负债总计	-	-	-	175,498.31	175,498.31
利率敏感度缺口	4,726,171.72	-	-	63,562,072.50	68,288,244.22
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	446,119.90	-	-	-	446,119.90
结算备付金	16,054.03	-	-	-	16,054.03
存出保证金	23,191.81	-	-	-	23,191.81
交易性金融资产	1,812,019.26	-	-	32,890,653.77	34,702,673.03
买入返售金融资产	200,000.00	-	-	-	200,000.00
应收申购款	-	-	-	35,494.45	35,494.45
资产总计	2,497,385.00	-	-	32,926,148.22	35,423,533.22
负债					
应付清算款	-	-	-	200,000.00	200,000.00

应付赎回款	-	-	-	59,036.03	59,036.03
应付管理人报酬	-	-	-	13,439.17	13,439.17
应付托管费	-	-	-	2,986.48	2,986.48
应交税费	-	-	-	10.09	10.09
其他负债	-	-	-	67,874.71	67,874.71
负债总计	-	-	-	343,346.48	343,346.48
利率敏感度缺口	2,497,385.00	-	-	32,582,801.74	35,080,186.74

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1. 市场利率上升25个基点	-4,142.62	-2,575.11
	2. 市场利率下降25个基点	4,163.04	2,585.56

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

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量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 2024年06月30日		上年度末 2023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	63,716,880.41	93.31	32,890,653.77	93.76
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	63,716,880.41	93.31	32,890,653.77	93.76

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1. 业绩比较基准增加5%	3,158,726.05	1,666,764.99
	2. 业绩比较基准减少5%	-3,158,726.05	-1,666,764.99

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的公开报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	63,716,880.41	32,890,653.77
第二层次	3,444,138.61	1,812,019.26
第三层次	-	-
合计	67,161,019.02	34,702,673.03

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根

据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	63,716,880.41	93.07
	其中：股票	63,716,880.41	93.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,444,138.61	5.03
	其中：债券	3,444,138.61	5.03
	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	400,000.00	0.58
	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	872,973.49	1.28
8	其他各项资产	29,750.02	0.04
9	合计	68,463,742.53	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	398,843.00	0.58
B	采矿业	2,975,559.06	4.36
C	制造业	40,327,143.17	59.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,560,949.29	3.75
E	建筑业	647,289.00	0.95
F	批发和零售业	1,348,963.46	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,280,642.00	1.88
H	住宿和餐饮业	201,769.00	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,527,841.24	6.63
J	金融业	5,907,552.17	8.65
K	房地产业	719,686.78	1.05
L	租赁和商务服务业	486,025.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	508,593.40	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	289,472.08	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	70,839.00	0.10
Q	卫生和社会工作	394,242.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	957,422.76	1.40
S	综合	114,048.00	0.17
	合计	63,716,880.41	93.31

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	-	-

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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所有股票投资明细

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	300502	新易盛	7,600	802,180.00	1.17
2	601077	渝农商行	100,900	506,518.00	0.74
3	002028	思源电气	6,600	441,540.00	0.65
4	688169	石头科技	1,020	400,452.00	0.59
5	601058	赛轮轮胎	28,200	394,800.00	0.58
6	600066	宇通客车	14,200	366,360.00	0.54
7	002340	格林美	55,100	350,987.00	0.51
8	000933	神火股份	16,900	341,887.00	0.50
9	000988	华工科技	10,800	323,244.00	0.47
10	601168	西部矿业	17,900	321,305.00	0.47
11	300394	天孚通信	3,600	318,312.00	0.47
12	002384	东山精密	14,700	304,290.00	0.45
13	000423	东阿阿胶	4,800	300,480.00	0.44
14	000630	铜陵有色	82,300	297,103.00	0.44
15	600418	江淮汽车	18,700	296,208.00	0.43
16	600988	赤峰黄金	17,800	290,852.00	0.43
17	601233	桐昆股份	18,100	288,876.00	0.42
18	600157	永泰能源	238,200	281,076.00	0.41
19	002625	光启技术	16,200	281,070.00	0.41
20	688617	惠泰医疗	600	273,660.00	0.40
21	600096	云天化	13,800	267,996.00	0.39
22	601567	三星医疗	7,600	266,000.00	0.39
23	000400	许继电气	7,600	261,516.00	0.38
24	603529	爱玛科技	9,400	256,902.00	0.38
25	688777	中控技术	6,800	256,360.00	0.38
26	002156	通富微电	11,400	255,246.00	0.37
27	002273	水晶光电	14,898	252,968.04	0.37

28	002128	电投能源	11,980	252,778.00	0.37
29	601555	东吴证券	42,660	251,694.00	0.37
30	002078	太阳纸业	18,000	251,100.00	0.37
31	600885	宏发股份	8,920	246,905.60	0.36
32	300207	欣旺达	16,000	242,720.00	0.36
33	002223	鱼跃医疗	6,450	242,520.00	0.36
34	002532	天山铝业	29,900	242,489.00	0.36
35	600352	浙江龙盛	27,900	239,661.00	0.35
36	600398	海澜之家	25,700	237,468.00	0.35
37	002138	顺络电子	8,600	236,156.00	0.35
38	002966	苏州银行	31,410	235,575.00	0.34
39	002353	杰瑞股份	6,600	231,528.00	0.34
40	601108	财通证券	34,900	230,689.00	0.34
41	600765	中航重机	11,080	226,032.00	0.33
42	002185	华天科技	27,500	224,125.00	0.33
43	002517	恺英网络	23,100	220,605.00	0.32
44	600879	航天电子	28,300	219,891.00	0.32
45	301236	软通动力	6,100	214,781.00	0.31
46	603606	东方电缆	4,400	214,764.00	0.31
47	600873	梅花生物	21,400	214,428.00	0.31
48	688099	晶晨股份	3,600	213,552.00	0.31
49	600177	雅戈尔	29,800	212,176.00	0.31
50	601577	长沙银行	25,900	211,862.00	0.31
51	600079	人福医药	12,300	211,191.00	0.31
52	002738	中矿资源	7,860	210,648.00	0.31
53	600109	国金证券	27,900	210,645.00	0.31
54	300003	乐普医疗	14,100	209,244.00	0.31
55	600060	海信视像	8,400	207,816.00	0.30
56	300017	网宿科技	26,200	206,980.00	0.30
57	600497	驰宏锌锗	38,200	203,988.00	0.30
58	300136	信维通信	10,400	203,632.00	0.30

59	603979	金诚信	4,000	202,120.00	0.30
60	603160	汇顶科技	2,900	199,375.00	0.29
61	002202	金风科技	29,600	198,912.00	0.29
62	002739	万达电影	16,400	198,276.00	0.29
63	000932	华菱钢铁	44,480	197,046.40	0.29
64	002409	雅克科技	3,100	195,021.00	0.29
65	002958	青农商行	72,400	194,032.00	0.28
66	000683	远兴能源	28,000	193,480.00	0.28
67	600985	淮北矿业	11,549	193,330.26	0.28
68	600536	中国软件	6,461	193,313.12	0.28
69	600348	华阳股份	19,350	192,726.00	0.28
70	002465	海格通信	18,600	192,696.00	0.28
71	002281	光迅科技	5,100	190,587.00	0.28
72	002444	巨星科技	7,700	190,190.00	0.28
73	000009	中国宝安	22,100	190,060.00	0.28
74	688120	华海清科	1,000	189,580.00	0.28
75	002008	大族激光	9,000	187,200.00	0.27
76	000878	云南铜业	15,009	187,012.14	0.27
77	002436	兴森科技	18,100	186,792.00	0.27
78	300474	景嘉微	2,950	186,528.50	0.27
79	600642	申能股份	21,023	185,633.09	0.27
80	601615	明阳智能	19,500	184,080.00	0.27
81	688122	西部超导	4,800	183,936.00	0.27
82	002797	第一创业	36,000	183,240.00	0.27
83	000039	中集集团	19,720	182,607.20	0.27
84	601990	南京证券	23,700	182,016.00	0.27
85	000066	中国长城	20,800	182,000.00	0.27
86	600298	安琪酵母	6,500	181,545.00	0.27
87	300054	鼎龙股份	8,000	181,440.00	0.27
88	300012	华测检测	18,000	181,080.00	0.27
89	600529	山东药玻	7,100	179,914.00	0.26

90	688525	佰维存储	2,800	179,620.00	0.26
91	002673	西部证券	28,800	178,272.00	0.26
92	601666	平煤股份	15,900	178,080.00	0.26
93	600839	四川长虹	39,629	177,934.21	0.26
94	603596	伯特利	4,560	177,384.00	0.26
95	601179	中国西电	22,000	176,880.00	0.26
96	000831	中国稀土	6,800	172,380.00	0.25
97	300395	菲利华	5,600	172,200.00	0.25
98	000783	长江证券	35,600	171,948.00	0.25
99	601717	郑煤机	11,600	171,680.00	0.25
100	603816	顾家家居	5,300	171,137.00	0.25
101	000738	航发控制	8,500	170,595.00	0.25
102	300002	神州泰岳	21,000	170,520.00	0.25
103	000728	国元证券	28,100	170,286.00	0.25
104	002432	九安医疗	4,200	170,268.00	0.25
105	600862	中航高科	9,000	169,020.00	0.25
106	688180	君实生物	5,800	168,490.00	0.25
107	000703	恒逸石化	23,600	167,324.00	0.25
108	601198	东兴证券	20,800	165,568.00	0.24
109	601997	贵阳银行	31,400	165,478.00	0.24
110	000960	锡业股份	10,600	164,194.00	0.24
111	002595	豪迈科技	4,300	164,131.00	0.24
112	002155	湖南黄金	9,048	163,768.80	0.24
113	603345	安井食品	2,200	163,482.00	0.24
114	603338	浙江鼎力	2,700	163,134.00	0.24
115	300037	新宙邦	5,700	162,792.00	0.24
116	601696	中银证券	17,900	162,532.00	0.24
117	600863	内蒙华电	35,000	162,400.00	0.24
118	300724	捷佳伟创	3,000	162,030.00	0.24
119	601162	天风证券	74,300	161,974.00	0.24
120	000921	海信家电	5,000	161,200.00	0.24

121	002472	双环传动	7,300	160,746.00	0.24
122	600038	中直股份	3,900	160,329.00	0.23
123	600521	华海药业	9,400	160,270.00	0.23
124	002294	信立泰	6,000	159,780.00	0.23
125	300866	安克创新	2,240	159,510.40	0.23
126	002984	森麒麟	6,600	158,994.00	0.23
127	300001	特锐德	7,900	158,948.00	0.23
128	603939	益丰药房	6,452	158,396.60	0.23
129	600141	兴发集团	8,300	158,364.00	0.23
130	600549	厦门钨业	9,100	156,975.00	0.23
131	002407	多氟多	12,820	156,788.60	0.23
132	600699	均胜电子	10,540	156,202.80	0.23
133	600546	山煤国际	10,600	154,972.00	0.23
134	300699	光威复材	6,220	154,442.60	0.23
135	002262	恩华药业	6,500	154,310.00	0.23
136	301358	湖南裕能	4,900	154,154.00	0.23
137	600820	隧道股份	23,600	154,108.00	0.23
138	300285	国瓷材料	8,600	153,510.00	0.22
139	600895	张江高科	8,300	153,384.00	0.22
140	600369	西南证券	42,800	153,224.00	0.22
141	002195	岩山科技	60,950	152,984.50	0.22
142	603589	口子窖	3,900	152,841.00	0.22
143	002850	科达利	2,000	152,760.00	0.22
144	002064	华峰化学	21,300	152,721.00	0.22
145	600872	中炬高新	6,700	152,023.00	0.22
146	000021	深科技	10,000	151,200.00	0.22
147	601000	唐山港	31,800	149,460.00	0.22
148	600021	上海电力	15,100	149,339.00	0.22
149	000513	丽珠集团	4,000	148,840.00	0.22
150	600486	扬农化工	2,630	148,463.50	0.22
151	603087	甘李药业	3,200	148,224.00	0.22

152	300146	汤臣倍健	10,900	147,695.00	0.22
153	300073	当升科技	4,300	147,533.00	0.22
154	688188	柏楚电子	792	146,163.60	0.21
155	688065	凯赛生物	3,200	145,248.00	0.21
155	300058	蓝色光标	26,700	145,248.00	0.21
157	603179	新泉股份	3,700	145,188.00	0.21
158	601966	玲珑轮胎	7,900	145,123.00	0.21
159	600704	物产中大	33,400	144,956.00	0.21
160	300114	中航电测	3,200	144,800.00	0.21
161	600153	建发股份	16,100	143,773.00	0.21
162	600155	华创云信	24,247	143,299.77	0.21
163	002756	永兴材料	4,000	143,120.00	0.21
164	000830	鲁西化工	12,300	142,557.00	0.21
165	300529	健帆生物	5,200	141,492.00	0.21
166	600583	海油工程	23,700	140,067.00	0.21
167	600118	中国卫星	6,300	140,049.00	0.21
168	002558	巨人网络	14,800	139,712.00	0.20
169	002152	广电运通	13,300	139,118.00	0.20
170	601156	东航物流	6,800	138,380.00	0.20
171	000591	太阳能	29,300	138,003.00	0.20
172	000623	吉林敖东	10,218	136,921.20	0.20
173	600970	中材国际	11,300	136,278.00	0.20
174	300373	扬杰科技	3,500	136,150.00	0.20
175	002385	大北农	35,300	135,905.00	0.20
176	300144	宋城演艺	16,900	135,707.00	0.20
177	002439	启明星辰	7,800	134,628.00	0.20
178	002025	航天电器	2,900	134,502.00	0.20
179	605358	立昂微	5,800	134,212.00	0.20
180	600380	健康元	12,000	134,040.00	0.20
181	601216	君正集团	36,200	133,578.00	0.20
182	000729	燕京啤酒	15,100	133,333.00	0.20

183	000723	美锦能源	27,800	132,328.00	0.19
184	688301	奕瑞科技	1,148	132,284.04	0.19
185	600143	金发科技	20,000	132,200.00	0.19
186	600998	九州通	27,074	132,121.12	0.19
187	300251	光线传媒	15,700	132,037.00	0.19
188	000519	中兵红箭	9,000	132,030.00	0.19
189	600282	南钢股份	26,400	131,472.00	0.19
190	300677	英科医疗	4,900	131,369.00	0.19
191	600637	东方明珠	21,600	131,328.00	0.19
192	600516	方大炭素	30,200	130,162.00	0.19
193	300383	光环新网	15,400	130,130.00	0.19
194	600763	通策医疗	2,400	129,720.00	0.19
195	300024	机器人	13,300	129,542.00	0.19
196	600392	盛和资源	15,000	129,300.00	0.19
197	000636	风华高科	9,900	129,294.00	0.19
198	000818	航锦科技	5,800	128,064.00	0.19
199	600909	华安证券	30,220	127,226.20	0.19
200	601665	齐鲁银行	25,900	127,169.00	0.19
201	002044	美年健康	33,600	127,008.00	0.19
202	600566	济川药业	4,000	126,840.00	0.19
203	600008	首创环保	47,200	126,496.00	0.19
204	000883	湖北能源	21,000	126,210.00	0.18
205	688213	思特威	2,600	126,100.00	0.18
206	600867	通化东宝	14,900	124,713.00	0.18
207	601016	节能风电	41,700	124,683.00	0.18
208	000629	钒钛股份	49,800	124,500.00	0.18
209	300088	长信科技	26,300	123,610.00	0.18
210	601456	国联证券	12,800	123,392.00	0.18
211	600511	国药股份	4,000	123,160.00	0.18
212	000997	新大陆	8,850	123,103.50	0.18
213	600170	上海建工	57,200	122,980.00	0.18

214	600582	天地科技	17,800	122,642.00	0.18
215	600129	太极集团	4,200	121,464.00	0.18
216	600499	科达制造	14,400	121,392.00	0.18
217	600498	烽火通信	7,600	120,840.00	0.18
218	601933	永辉超市	48,700	120,776.00	0.18
219	600535	天士力	9,600	120,768.00	0.18
220	600004	白云机场	12,700	120,396.00	0.18
221	000598	兴蓉环境	16,000	120,320.00	0.18
222	601991	大唐发电	39,900	120,099.00	0.18
223	002120	韵达股份	15,500	119,970.00	0.18
224	000750	国海证券	41,100	119,601.00	0.18
225	002261	拓维信息	10,800	119,556.00	0.18
226	000060	中金岭南	28,100	119,144.00	0.17
227	600580	卧龙电驱	9,800	119,070.00	0.17
228	300567	精测电子	2,100	118,671.00	0.17
229	300118	东方日升	9,800	118,580.00	0.17
230	300568	星源材质	14,400	118,080.00	0.17
231	603486	科沃斯	2,500	117,950.00	0.17
232	603000	人民网	5,900	117,941.00	0.17
233	002430	杭氧股份	5,300	117,925.00	0.17
234	688052	纳芯微	1,146	117,785.88	0.17
235	002429	兆驰股份	24,300	116,883.00	0.17
236	603228	景旺电子	3,647	115,974.60	0.17
237	002939	长城证券	17,300	115,910.00	0.17
238	600166	福田汽车	51,500	115,875.00	0.17
239	603658	安图生物	2,500	115,175.00	0.17
240	600325	华发股份	17,700	115,050.00	0.17
241	603156	养元饮品	5,400	114,858.00	0.17
242	600816	建元信托	42,200	114,362.00	0.17
243	600673	东阳光	16,200	114,048.00	0.17
244	601231	环旭电子	7,100	113,955.00	0.17

245	603568	伟明环保	5,526	113,725.08	0.17
246	300765	新诺威	4,500	113,535.00	0.17
247	603927	中科软	6,256	113,171.04	0.17
248	000893	亚钾国际	7,000	113,120.00	0.17
249	300487	蓝晓科技	2,700	112,752.00	0.17
250	002508	老板电器	5,100	112,710.00	0.17
251	600754	锦江酒店	4,900	112,602.00	0.16
252	300601	康泰生物	7,200	112,392.00	0.16
253	603290	斯达半导	1,300	111,943.00	0.16
254	000027	深圳能源	15,320	111,836.00	0.16
255	601636	旗滨集团	17,300	111,585.00	0.16
256	002926	华西证券	16,900	111,371.00	0.16
257	000998	隆平高科	11,300	111,079.00	0.16
258	002624	完美世界	14,600	110,960.00	0.16
259	002497	雅化集团	12,400	110,608.00	0.16
260	002653	海思科	3,600	110,520.00	0.16
261	688114	华大智造	2,328	110,370.48	0.16
262	600737	中粮糖业	11,500	110,285.00	0.16
263	603298	杭叉集团	5,600	109,984.00	0.16
264	601866	中远海发	42,500	109,650.00	0.16
265	603077	和邦生物	66,300	109,395.00	0.16
266	300253	卫宁健康	18,500	109,150.00	0.16
267	002299	圣农发展	8,000	109,120.00	0.16
268	688002	睿创微纳	3,900	109,083.00	0.16
269	002065	东华软件	24,100	108,932.00	0.16
270	300604	长川科技	4,000	108,680.00	0.16
271	300390	天华新能	6,320	108,577.60	0.16
272	002500	山西证券	23,100	108,570.00	0.16
273	002056	横店东磁	8,700	108,489.00	0.16
274	601958	金钼股份	10,400	108,264.00	0.16
274	300763	锦浪科技	2,600	108,264.00	0.16

276	600373	中文传媒	7,294	108,242.96	0.16
277	600131	国网信通	6,400	107,968.00	0.16
278	002414	高德红外	18,300	107,787.00	0.16
279	600655	豫园股份	20,900	107,635.00	0.16
280	688772	珠海冠宇	7,202	107,309.80	0.16
281	300009	安科生物	12,556	107,228.24	0.16
282	688385	复旦微电	3,400	106,692.00	0.16
283	600563	法拉电子	1,400	106,652.00	0.16
284	603893	瑞芯微	1,800	106,506.00	0.16
285	002368	太极股份	4,720	106,436.00	0.16
286	002507	涪陵榨菜	8,650	105,962.50	0.16
287	600707	彩虹股份	15,400	104,874.00	0.15
288	002372	伟星新材	6,800	104,856.00	0.15
289	603885	吉祥航空	9,500	104,405.00	0.15
290	601611	中国核建	12,900	104,361.00	0.15
291	688390	固德威	1,859	104,327.08	0.15
292	000887	中鼎股份	8,470	103,672.80	0.15
293	603379	三美股份	2,620	102,546.80	0.15
294	002203	海亮股份	12,807	102,199.86	0.15
295	002831	裕同科技	3,989	102,078.51	0.15
296	600755	厦门国贸	14,200	101,814.00	0.15
297	688521	芯原股份	3,800	101,650.00	0.15
298	603225	新凤鸣	6,520	101,646.80	0.15
299	600329	达仁堂	3,100	100,409.00	0.15
300	600859	王府井	8,500	99,790.00	0.15
301	600995	南网储能	10,300	99,498.00	0.15
302	601880	辽港股份	80,800	99,384.00	0.15
303	600801	华新水泥	7,200	99,000.00	0.14
304	002683	广东宏大	4,900	98,637.00	0.14
305	600416	湘电股份	9,900	98,406.00	0.14
306	600884	杉杉股份	12,100	98,252.00	0.14

307	300296	利亚德	21,700	97,650.00	0.14
308	002019	亿帆医药	7,900	97,644.00	0.14
309	300070	碧水源	23,300	97,627.00	0.14
310	600390	五矿资本	24,100	97,605.00	0.14
311	600435	北方导航	11,302	97,423.24	0.14
312	002506	协鑫集成	50,200	97,388.00	0.14
313	002244	滨江集团	13,300	96,558.00	0.14
314	600739	辽宁成大	11,500	96,255.00	0.14
315	000050	深天马 A	13,200	96,096.00	0.14
316	600483	福能股份	8,200	95,612.00	0.14
317	601098	中南传媒	7,690	95,509.80	0.14
318	601598	中国外运	16,900	95,147.00	0.14
318	600399	抚顺特钢	16,900	95,147.00	0.14
320	300748	金力永磁	7,340	95,126.40	0.14
321	002572	索菲亚	6,200	95,046.00	0.14
322	600598	北大荒	7,600	94,924.00	0.14
323	300803	指南针	2,600	94,666.00	0.14
324	600901	江苏金租	18,720	94,536.00	0.14
325	300676	华大基因	2,700	94,527.00	0.14
326	002568	百润股份	5,600	94,248.00	0.14
327	600848	上海临港	10,300	93,833.00	0.14
328	002487	大金重工	4,100	93,808.00	0.14
329	000155	川能动力	8,700	93,699.00	0.14
330	002080	中材科技	7,200	92,880.00	0.14
331	002240	盛新锂能	6,900	92,598.00	0.14
332	002373	千方科技	10,200	92,514.00	0.14
333	001286	陕西能源	8,000	92,240.00	0.14
334	002936	郑州银行	53,090	91,845.70	0.13
335	002557	洽洽食品	3,252	91,673.88	0.13
336	603712	七一二	5,000	90,950.00	0.13
337	300595	欧普康视	5,800	90,944.00	0.13

338	000563	陕国投 A	32,900	90,475.00	0.13
339	601928	凤凰传媒	8,200	89,872.00	0.13
340	600968	海油发展	21,800	89,816.00	0.13
341	002268	电科网安	6,300	89,649.00	0.13
342	000778	新兴铸管	25,700	89,436.00	0.13
343	603858	步长制药	5,900	89,385.00	0.13
344	600258	首旅酒店	7,220	89,167.00	0.13
345	688234	天岳先进	1,900	89,148.00	0.13
346	603883	老百姓	4,849	89,027.64	0.13
347	603444	吉比特	500	89,005.00	0.13
348	601212	白银有色	31,800	88,404.00	0.13
349	688538	和辉光电	44,476	88,062.48	0.13
350	688536	思瑞浦	900	88,029.00	0.13
351	300558	贝达药业	2,700	87,885.00	0.13
352	600271	航天信息	11,900	87,584.00	0.13
353	603688	石英股份	2,950	87,349.50	0.13
354	600062	华润双鹤	4,460	87,326.80	0.13
355	600528	中铁工业	11,900	87,108.00	0.13
356	688331	荣昌生物	2,000	86,400.00	0.13
357	600977	中国电影	8,000	86,080.00	0.13
358	601155	新城控股	9,700	86,039.00	0.13
359	000709	河钢股份	44,300	85,942.00	0.13
360	002531	天顺风能	9,600	85,824.00	0.13
361	000739	普洛药业	6,300	85,491.00	0.13
362	002408	齐翔腾达	15,240	85,344.00	0.12
363	600959	江苏有线	32,200	85,008.00	0.12
364	600378	昊华科技	2,900	83,810.00	0.12
365	688005	容百科技	3,600	83,808.00	0.12
366	601118	海南橡胶	18,400	83,720.00	0.12
367	000825	太钢不锈	24,500	82,810.00	0.12
368	688220	翱捷科技	2,200	82,412.00	0.12

369	688017	绿的谐波	1,000	82,100.00	0.12
370	603737	三棵树	2,260	81,970.20	0.12
371	603882	金域医学	3,000	81,570.00	0.12
372	600612	老凤祥	1,400	81,466.00	0.12
373	600056	中国医药	8,020	81,162.40	0.12
374	000987	越秀资本	16,185	80,277.60	0.12
375	600906	财达证券	13,930	79,818.90	0.12
376	601399	国机重装	30,900	79,722.00	0.12
377	600517	国网英大	18,400	79,672.00	0.12
378	603456	九洲药业	5,800	79,576.00	0.12
379	601019	山东出版	6,700	79,194.00	0.12
380	300212	易华录	4,700	79,101.00	0.12
381	002266	浙富控股	28,000	78,120.00	0.11
382	688063	派能科技	1,960	77,831.60	0.11
383	603650	彤程新材	2,600	76,830.00	0.11
384	600316	洪都航空	4,600	76,498.00	0.11
385	000937	冀中能源	11,400	76,380.00	0.11
386	600871	石化油服	43,700	76,038.00	0.11
387	600925	苏能股份	14,800	74,740.00	0.11
388	688567	孚能科技	7,784	74,726.40	0.11
389	002423	中粮资本	9,900	74,151.00	0.11
390	000032	深桑达A	4,900	73,402.00	0.11
391	688200	华峰测控	800	73,400.00	0.11
392	601965	中国汽研	4,300	72,627.00	0.11
393	001227	兰州银行	30,500	72,590.00	0.11
394	603728	鸣志电器	1,800	72,414.00	0.11
395	600098	广州发展	11,300	72,320.00	0.11
396	600208	新湖中宝	45,600	72,048.00	0.11
397	601298	青岛港	7,500	71,700.00	0.10
398	688561	奇安信	3,000	70,860.00	0.10
399	002607	中公教育	46,300	70,839.00	0.10

400	601608	中信重工	18,583	70,801.23	0.10
401	688516	奥特维	1,692	70,742.52	0.10
402	600663	陆家嘴	8,000	70,560.00	0.10
403	002670	国盛金控	8,300	70,301.00	0.10
404	688297	中无人机	2,127	70,254.81	0.10
405	603233	大参林	4,900	70,070.00	0.10
406	600022	山东钢铁	57,360	69,979.20	0.10
407	300438	鹏辉能源	3,800	69,692.00	0.10
408	600578	京能电力	21,500	69,660.00	0.10
409	300776	帝尔激光	1,500	68,940.00	0.10
410	300357	我武生物	3,400	68,748.00	0.10
411	003031	中瓷电子	1,480	68,435.20	0.10
412	688032	禾迈股份	596	68,408.88	0.10
413	601106	中国一重	29,400	67,914.00	0.10
414	600500	中化国际	19,200	67,008.00	0.10
415	600377	宁沪高速	5,300	66,780.00	0.10
416	000785	居然之家	27,000	65,610.00	0.10
417	600967	内蒙一机	9,100	65,520.00	0.10
418	002865	钧达股份	1,700	65,246.00	0.10
419	600350	山东高速	7,300	64,605.00	0.09
420	600315	上海家化	3,600	64,008.00	0.09
421	688349	三一重能	2,568	63,789.12	0.09
422	300888	稳健医疗	2,520	63,756.00	0.09
423	600827	百联股份	8,615	63,578.70	0.09
424	601568	北元集团	17,080	63,366.80	0.09
425	000958	电投产融	17,300	63,318.00	0.09
426	688425	铁建重工	17,200	63,296.00	0.09
427	000537	中绿电	6,640	63,279.20	0.09
428	000559	万向钱潮	14,183	63,256.18	0.09
429	002690	美亚光电	3,811	62,881.50	0.09
430	688029	南微医学	1,020	62,791.20	0.09

431	002608	江苏国信	8,100	62,775.00	0.09
432	000156	华数传媒	9,900	62,172.00	0.09
433	002867	周大生	4,750	62,035.00	0.09
434	603517	绝味食品	4,000	61,600.00	0.09
435	603707	健友股份	5,162	61,324.56	0.09
436	601992	金隅集团	44,700	61,239.00	0.09
437	603826	坤彩科技	2,100	60,837.00	0.09
438	600126	杭钢股份	14,500	59,595.00	0.09
439	300682	朗新集团	7,000	59,570.00	0.09
440	688778	厦钨新能	1,900	59,356.00	0.09
441	003022	联泓新科	4,300	58,953.00	0.09
442	603786	科博达	900	57,735.00	0.08
443	000967	盈峰环境	13,600	57,528.00	0.08
444	603218	日月股份	5,500	56,485.00	0.08
445	600339	中油工程	18,000	56,160.00	0.08
446	600032	浙江新能	7,700	56,056.00	0.08
447	600481	双良节能	12,000	56,040.00	0.08
448	600361	创新新材	13,900	56,017.00	0.08
449	301267	华夏眼科	2,700	55,944.00	0.08
450	600095	湘财股份	9,200	54,832.00	0.08
451	688475	萤石网络	1,600	54,576.00	0.08
452	000898	鞍钢股份	25,600	54,272.00	0.08
453	003035	南网能源	12,200	53,680.00	0.08
454	603127	昭衍新药	4,020	53,345.40	0.08
455	688248	南网科技	1,800	53,334.00	0.08
456	688520	神州细胞	1,350	53,122.50	0.08
457	600808	马钢股份	25,800	52,116.00	0.08
458	002563	森马服饰	8,700	50,547.00	0.07
459	002153	石基信息	8,820	50,538.60	0.07
460	603185	弘元绿能	2,900	49,561.00	0.07
461	601228	广州港	16,200	49,410.00	0.07

462	000539	粤电力 A	9,500	48,260.00	0.07
463	688779	长远锂科	10,400	48,152.00	0.07
464	001872	招商港口	2,500	48,125.00	0.07
465	001203	大中矿业	4,900	47,089.00	0.07
466	600928	西安银行	14,300	46,761.00	0.07
467	688281	华秦科技	560	46,659.20	0.07
468	688006	杭可科技	2,660	46,417.00	0.07
469	000401	冀东水泥	11,400	46,284.00	0.07
470	000959	首钢股份	16,700	45,424.00	0.07
471	600764	中国海防	2,300	45,149.00	0.07
472	002518	科士达	2,500	44,250.00	0.06
473	603056	德邦股份	3,300	43,230.00	0.06
474	688375	国博电子	600	42,384.00	0.06
475	603305	旭升集团	4,000	42,240.00	0.06
476	688172	燕东微	2,600	42,068.00	0.06
477	600299	安迪苏	4,300	41,710.00	0.06
478	601139	深圳燃气	6,200	41,416.00	0.06
479	300861	美畅股份	2,100	40,635.00	0.06
480	688276	百克生物	1,400	39,718.00	0.06
481	603317	天味食品	3,399	38,782.59	0.06
482	688387	信科移动	7,400	37,296.00	0.05
483	301029	怡合达	1,860	36,567.60	0.05
484	002791	坚朗五金	1,400	36,218.00	0.05
485	600927	永安期货	3,100	34,565.00	0.05
486	688819	天能股份	1,448	34,549.28	0.05
487	601858	中国科传	1,700	32,504.00	0.05
488	000031	大悦城	13,767	32,214.78	0.05
489	688107	安路科技	1,200	30,504.00	0.04
490	601158	重庆水务	6,200	29,760.00	0.04
491	688153	唯捷创芯	800	29,600.00	0.04
492	601828	美凯龙	11,600	29,580.00	0.04

493	002945	华林证券	2,900	28,942.00	0.04
494	688348	昱能科技	490	28,910.00	0.04
495	600956	新天绿能	3,300	26,961.00	0.04
496	301165	锐捷网络	700	20,888.00	0.03
497	688295	中复神鹰	1,000	20,300.00	0.03
498	603868	飞科电器	500	19,200.00	0.03

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	000540	*ST中天	27,500	-	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	300502	新易盛	354,643.00	1.01
2	601077	渝农商行	324,191.00	0.92
3	688777	中控技术	283,820.79	0.81
4	601058	赛轮轮胎	271,009.00	0.77
5	002422	科伦药业	266,305.00	0.76
6	688617	惠泰医疗	264,411.80	0.75
7	603529	爱玛科技	255,999.00	0.73
8	002028	思源电气	254,080.00	0.72
9	688169	石头科技	252,332.00	0.72
10	601567	三星医疗	251,806.00	0.72
11	002463	沪电股份	248,964.00	0.71
12	002202	金风科技	225,256.00	0.64

13	601168	西部矿业	218,156.00	0.62
14	000933	神火股份	216,077.00	0.62
15	300394	天孚通信	213,532.00	0.61
16	000975	银泰黄金	213,284.00	0.61
17	601615	明阳智能	211,550.00	0.60
18	600066	宇通客车	209,791.00	0.60
19	603979	金诚信	205,800.00	0.59
20	002436	兴森科技	204,168.00	0.58

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	002463	沪电股份	543,493.00	1.55
2	002422	科伦药业	453,445.00	1.29
3	000975	银泰黄金	360,862.00	1.03
4	600160	巨化股份	337,734.24	0.96
5	300418	昆仑万维	323,598.00	0.92
6	600161	天坛生物	282,600.00	0.81
7	600415	小商品城	247,265.00	0.70
8	688072	拓荆科技	226,194.75	0.64
9	600482	中国动力	223,067.00	0.64
10	002600	领益智造	157,483.00	0.45
11	688728	格科微	112,476.00	0.32
12	002966	苏州银行	108,394.00	0.31
13	000581	威孚高科	104,052.00	0.30
14	002131	利欧股份	103,043.00	0.29
15	002032	苏泊尔	97,110.00	0.28
16	000547	航天发展	90,551.21	0.26

17	601187	厦门银行	88,006.00	0.25
18	300026	红日药业	86,548.00	0.25
19	000970	中科三环	85,626.00	0.24
20	601778	晶科科技	84,037.00	0.24

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	45,162,446.19
卖出股票收入（成交）总额	8,241,410.99

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	3,431,137.64	5.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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)	13,000.97	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,444,138.61	5.04

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	019740	24国债09	18,000	1,806,153.53	2.64

2	019709	23国债16	16,000	1,624,984.11	2.38
3	113685	N升24转	130	13,000.97	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

思源电气（代码：002028.SZ）为本基金前十大持仓证券。2023年11月10日，据中华人民共和国洋山港海事局发布的行政处罚信息显示，思源电气股份有限公司因托运人未将托运的危险货物的正式名称、危险性质以及应当采取的防护措施通知承运人，中华人民共和国洋山港海事局对其处以罚款6万元。

渝农商行（代码：601077.SH）为本基金前十大持仓证券。2023年11月9日，据重庆市江北区市场监督管理局发布的行政处罚信息显示，重庆农村商业银行股份有限公司因涉嫌使用不合格消毒餐碗的行为，重庆市江北区市场监督管理局责令公司改正违法行为，并作出警告处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外，本基金投资的其他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出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,059.62
2	应收清算款	87.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,603.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,750.02

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	000540	*ST中天	-	0.00	摘牌

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
4,938	10,909.24	22,024,800.75	40.89%	31,845,036.95	59.11%

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	117,481.77	0.22%

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、基金投资和研发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	25,558,786.18
本报告期基金总申购份额	31,782,227.44
减：本报告期基金总赎回份额	3,471,175.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	53,869,837.70

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

2024年1月24日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，2024年1月5日新任公司公募基金事业部总经理贾鸣，原公司公募基金事业部总经理蔡红标因工作安排转任公司风险管理部总经理。

2024年4月13日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，2024年4月8日新任公司总裁黄本尧。

2024年6月20日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，2024年6月14日公司总裁黄本尧因工作调整离任。

本报告期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

本基金本报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员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	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	

	量					
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	18,439,742.00	34.53%	13,753.92	34.53%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	34,964,115.18	65.47%	26,079.40	65.47%	-

注：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：

本基金本报告期内无新增或退租的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	100,017.00	4.16%	1,600,000.00	5.74%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	2,302,777.33	95.84%	26,260,000.00	94.26%	-	-	-	-

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	关于旗下基金2023年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
2	人保中证500指数型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
3	中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-24
4	关于旗下基金在部分销售机构暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-01
5	关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-15

	的提示性公告		
6	人保中证500指数型证券投资基金招募说明书更新(2024年第1号)	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-15
7	人保中证500指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-15
8	公司旗下部分基金2023年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-30
9	人保中证500指数型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-30
10	中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-13
11	公司旗下基金2024年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
12	人保中证500指数型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
13	中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-20
14	关于旗下部分基金基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-21
15	人保中证500指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-21

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	20240517-20240630	-	22,024,800.75	-	22,024,800.75	40.89%
----	---	-------------------	---	---------------	---	---------------	--------

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

根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本基金自2024年6月28日起下调股票交易佣金费率。

§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规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、基金托管人处。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

基金托管人地址：中国（上海）长宁区仙霞路18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
二〇二四年八月三十一日