
人保沪深 300 指数型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 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:2019 年 08 月 24 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月22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2019年2月28日（基金合同生效日）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	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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	53
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55

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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	人保沪深300指数型证券投资基金
基金简称	人保沪深300
基金主代码	006600
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年02月28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	153,254,205.40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，紧密跟踪沪深300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	沪深300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		上海市浦东新区世纪大道119 8号世纪汇广场1座20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1 8号
邮政编码		100031	200336
法定代表人		缪建民	彭纯

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金半年度报告备置地点	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	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇广场1座20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（2019年02月28日（基金合同生效日）- 2019年06月30日）
本期已实现收益	-904,637.93

本期利润	3,344,118.18
加权平均基金份额本期利润	0.0385
本期加权平均净值利润率	3.84%
本期基金份额净值增长率	1.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配利润	-2,201,904.92
期末可供分配基金份额利润	-0.0144
期末基金资产净值	155,420,307.22
期末基金份额净值	1.0141
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2019年06月30日）
基金份额累计净值增长率	1.41%

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	5.36%	1.08%	5.13%	1.10%	0.23%	-0.02%
过去三个月	-1.45%	1.33%	-1.11%	1.45%	-0.34%	-0.12%
自基金合同生效起至今	1.41%	1.21%	3.85%	1.49%	-2.44%	-0.28%

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



注：1、本基金基金合同于2019年2月28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应符合基金合同的有关约定。截至报告期末，本基金尚处于建仓期内。

2、本基金业绩比较基准为：沪深300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、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，具有人社部批准的企业年金投资管理人资格和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，人保资产依托强大的资源优势和卓越的专业团队，秉承“忠人之事，超越基准”的企业精神，坚持“诚信铸就品牌，专业创造价值”的经营理念，不断开创市场化引领下创新驱动的专业化发展新局面，努力将公司打造成为具有市场竞争优势的国际一流、国内领先的综合性投资理财公司。

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2019年6月30日，人保资产旗下共管理18只基金产品，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和人保行业轮动混合型证券投资基金。

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	2019-02-28	-	5 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完成了建仓过程，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；4) 指数成份股的调整等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为1.0141元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.41%，同期业绩比较基准收益率为3.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年，宏观经济在总量指标逐步企稳的同时，仍存在一定的结构性压力。具体来说：社融存量同比增速及M2同比增速分别于2018年末和2019年初触底后企稳回升，固定资产投资增速及工业增加值增速也在低位逐步趋稳并缓慢回升，但从细分结构看，企业中长期贷款偏弱，制造业投资增速较低，且制造业PMI仍位于荣枯线下方，实体经济投资需求压缩，工业企业利润尚待改善。为对冲经济的结构性压力，货币政策有望加强逆周期调节，同时积极财政政策的效果也有望持续显现。

权益市场方面，在经历了一季度的上涨及二季度的调整后，主要指数在2019年上半年均取得了正收益，沪深300指数上涨27.07%，中证500指数上涨18.77%，创业板指数上涨20.87%。虽然取得了一定程度的涨幅，但主要指数的估值水平仍位于历史中位数或历史较低分位数附近，未出现显著高估，在国内流动性整体合理充裕，国外主要经济体降息预期逐渐升温的情况下，投资者风险偏好较难大幅下降，市场整体风险与机会并存，短期可能以震荡为主，中长期将随着业绩的逐步兑现和改善而不断抬高中枢。

本基金作为一只跟踪沪深300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

2019半年度，基金托管人在人保沪深300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

2019半年度，中国人保资产管理有限公司在人保沪深300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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2019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沪深300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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：人保沪深300指数型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	11,090,561.91
结算备付金		171,911.92
存出保证金		25,633.42
交易性金融资产	6.4.7.2	153,768,889.93
其中：股票投资		145,614,637.13
基金投资		-
债券投资		8,154,252.80
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		-
应收利息	6.4.7.5	139,065.76
应收股利		-
应收申购款		153,804.43
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		165,349,867.37

负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年06月30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		9,524,414.94
应付赎回款		162,799.99
应付管理人报酬		39,208.88
应付托管费		8,713.06
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	107,761.99
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	86,661.29
负债合计		9,929,560.15
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	153,254,205.40
未分配利润	6.4.7.10	2,166,101.82
所有者权益合计		155,420,307.22
负债和所有者权益总计		165,349,867.37

注：报告截止日2019年6月30日，人保沪深300基金份额净值为1.0141元，基金份额总额153,254,205.40份。

6.2 利润表

会计主体：人保沪深300指数型证券投资基金

本报告期：2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年02月28日(基金合同生效日)至2019年06月30日
一、收入		3,785,573.85
1. 利息收入		119,812.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	74,473.77
债券利息收入		39,815.25
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		5,523.97
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-848,182.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,721,013.60
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-175.67
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	873,007.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,248,756.11
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	265,186.97
减：二、费用		441,455.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	126,624.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	28,138.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	182,048.76
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.20	104,644.19

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,344,118.18
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,344,118.18

注：本基金基金合同于2019年2月28日生效，本报告期不是完整年度，按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：人保沪深300指数型证券投资基金

本报告期：2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2019年02月28日（基金合同生效日）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）	205,770,647.89	-	205,770,647.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,344,118.18	3,344,118.18
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）	-52,516,442.49	-1,178,016.36	-53,694,458.85
其中：1. 基金申购款	156,114,928.17	-1,076,655.02	155,038,273.15
2. 基金赎回款	-208,631,370.66	-101,361.34	-208,732,732.00
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）	153,254,205.40	2,166,101.82	155,420,307.22

注：本基金基金合同于2019年2月28日生效，本报告期不是完整年度，按实际存续期计算，无上年度可比期间数据。

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：

王颢

周海

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

人保沪深300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》、《人保沪深300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]1695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205,770,647.89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(19)第00031号验资报告。基金合同于2019年2月28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:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;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：沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*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2019年6月30日的财务状况以及2019年2月28日(基金合同生效日)至2019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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2019年2月28日(基金合同生效日)至2019年6月30止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会

认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按摊余成本和实际收益率计算确认利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券摊余成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认,由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.45%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

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

4) 本基金的每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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》、财税[2014]48号《关于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有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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;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其他增值税应税行为,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) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5) 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 2019年06月30日
----	--------------------

活期存款	11,090,561.91
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	11,090,561.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	141,354,191.88	145,614,637.13	4,260,445.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	8,165,941.94	8,154,252.80	-11,689.14
	银行间市场	-	-	-
	合计	8,165,941.94	8,154,252.80	-11,689.14
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	149,520,133.82	153,768,889.93	4,248,756.11	

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 2019年06月30日
应收活期存款利息	1,050.90
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	77.40
应收债券利息	137,925.96
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	-
其他	11.50
合计	139,065.76

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 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	107,761.99
银行间市场应付交易费用	-
合计	107,761.99

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	602.61
预提费用	36,058.68
其他应付	50,000.00
合计	86,661.29

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	205,770,647.89	205,770,647.89
本期申购	156,114,928.17	156,114,928.17
本期赎回（以“-”号填列）	-208,631,370.66	-208,631,370.66
本期末	153,254,205.40	153,254,205.40

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-904,637.93	4,248,756.11	3,344,118.18
本期基金份额交易产生的变动数	-1,297,266.99	119,250.63	-1,178,016.36
其中：基金申购款	-1,279,551.91	202,896.89	-1,076,655.02
基金赎回款	-17,715.08	-83,646.26	-101,361.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,201,904.92	4,368,006.74	2,166,101.82

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日
活期存款利息收入	73,154.94
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	1,234.80
其他	84.03
合计	74,473.77

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日
卖出股票成交总额	24,465,250.97
减：卖出股票成本总额	26,186,264.57
买卖股票差价收入	-1,721,013.60

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年02月28日（基金合同生效日）至2019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	-175.67
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	-175.67

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
	2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	69,755.89
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	68,243.67
减：应收利息总额	1,687.89
买卖债券差价收入	-175.67

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	873,007.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	873,007.05

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日

1. 交易性金融资产	4,248,756.11
——股票投资	4,260,445.25
——债券投资	-11,689.14
——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	4,248,756.11

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日
基金赎回费收入	265,186.97
合计	265,186.97

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日
交易所市场交易费用	182,048.76
银行间市场交易费用	-
合计	182,048.76

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日
审计费用	16,025.67
信息披露费	20,033.01
汇划手续费	807.73
其他费用_指数使用费	67,777.78
合计	104,644.19

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

截至报告日，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

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

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行权证交易，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行债券交易，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行回购交易，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无需要支付关联方的佣金，无上年度可比期间数据。

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 2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	126,624.07
其中：支付销售机构的客户维护费	19,539.26

注：支付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 2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	28,138.65

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

本基金报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2019年02月28日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	11,090,561.91	73,154.94

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须说明的其他关联交易事项，无上年度可比期间数据。

6.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

本基金本报告期末银行间市场无正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末交易所市场无正回购交易中作为抵押的债券。

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。

截止本报告期末，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2019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	11,090,561.91	-	-	-	11,090,561.91
结算备	171,911.92	-	-	-	171,911.92

付金					
存出保证金	25,633.42	-	-	-	25,633.42
交易性金融资产	8,154,252.80	-	-	145,614,637.13	153,768,889.93
应收利息	-	-	-	139,065.76	139,065.76
应收申购款	-	-	-	153,804.43	153,804.43
资产总计	19,442,360.05	-	-	145,907,507.32	165,349,867.37
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,524,414.94	9,524,414.94
应付赎回款	-	-	-	162,799.99	162,799.99
应付管理人报酬	-	-	-	39,208.88	39,208.88
应付托管费	-	-	-	8,713.06	8,713.06
应付交易费用	-	-	-	107,761.99	107,761.99
其他负债	-	-	-	86,661.29	86,661.29
负债总计	-	-	-	9,929,560.15	9,929,560.15
利率敏感度缺口	19,442,360.05	-	-	135,977,947.17	155,420,307.22

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	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 2019年06月30日
	市场利率上升25个基点	-9,387.39
	市场利率下降25个基点	9,426.10

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2019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 2019年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	145,614,637.13	93.69
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	8,154,252.80	5.25
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	153,768,889.93	98.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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 2019年06月30日
	业绩比较基准增加5%	7,299,207.75
	业绩比较基准减少5%	-7,326,076.37

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2019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145,614,637.13元，第二层次的余额为人民币8,154,252.80元，无属于第三层次的余额。

(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	145,614,637.13	88.06
	其中：股票	145,614,637.13	88.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,154,252.80	4.93
	其中：债券	8,154,252.80	4.93
	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	11,262,473.83	6.81
8	其他各项资产	318,503.61	0.19
9	合计	165,349,867.37	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	2,141,789.60	1.38
B	采矿业	4,674,266.00	3.01
C	制造业	57,826,791.03	37.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,296,122.90	2.12
E	建筑业	4,420,176.00	2.84

F	批发和零售业	2,000,508.80	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	4,474,521.76	2.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,272,972.50	3.39
J	金融业	51,126,510.07	32.90
K	房地产业	6,651,622.67	4.28
L	租赁和商务服务业	2,044,648.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	104,016.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	172,938.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	723,983.80	0.47
R	文化、体育和娱乐业	683,770.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	145,614,637.13	93.69

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
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	601318	中国平安	127,757	11,320,547.77	7.28

2	600519	贵州茅台	5,800	5,707,200.00	3.67
3	600036	招商银行	127,900	4,601,842.00	2.96
4	000651	格力电器	56,500	3,107,500.00	2.00
5	000333	美的集团	54,500	2,826,370.00	1.82
6	000858	五粮液	22,800	2,689,260.00	1.73
7	600887	伊利股份	71,907	2,402,412.87	1.55
8	600276	恒瑞医药	36,334	2,398,044.00	1.54
9	600030	中信证券	92,400	2,200,044.00	1.42
10	601288	农业银行	586,200	2,110,320.00	1.36
11	600016	民生银行	331,600	2,105,660.00	1.35
12	601398	工商银行	336,900	1,984,341.00	1.28
13	600000	浦发银行	159,800	1,866,464.00	1.20
14	000001	平安银行	118,700	1,635,686.00	1.05
15	000002	万科A	57,100	1,587,951.00	1.02
16	300498	温氏股份	43,660	1,565,647.60	1.01
17	601988	中国银行	380,800	1,424,192.00	0.92
18	601668	中国建筑	246,400	1,416,800.00	0.91
19	600900	长江电力	77,501	1,387,267.90	0.89
20	601601	中国太保	37,600	1,372,776.00	0.88
21	600837	海通证券	95,000	1,348,050.00	0.87
22	601169	北京银行	215,400	1,273,014.00	0.82
23	002415	海康威视	43,900	1,210,762.00	0.78
24	601939	建设银行	145,600	1,083,264.00	0.70
25	600048	保利地产	83,800	1,069,288.00	0.69
26	600104	上汽集团	41,100	1,048,050.00	0.67
27	601888	中国国旅	11,500	1,019,475.00	0.66
28	601229	上海银行	84,900	1,006,065.00	0.65
29	603288	海天味业	9,500	997,500.00	0.64
30	002142	宁波银行	40,802	989,040.48	0.64
31	600585	海螺水泥	23,600	979,400.00	0.63
32	601211	国泰君安	52,900	970,715.00	0.62

33	601818	光大银行	253,000	963,930.00	0.62
34	000725	京东方 A	278,400	957,696.00	0.62
35	601688	华泰证券	42,800	955,296.00	0.61
36	600009	上海机场	11,332	949,394.96	0.61
37	601766	中国中车	114,200	923,878.00	0.59
38	600031	三一重工	69,400	907,752.00	0.58
39	000063	中兴通讯	27,900	907,587.00	0.58
40	002304	洋河股份	7,100	863,076.00	0.56
41	600028	中国石化	157,000	858,790.00	0.55
42	300059	东方财富	63,080	854,734.00	0.55
43	600919	江苏银行	115,200	836,352.00	0.54
44	601009	南京银行	99,400	821,044.00	0.53
45	601088	中国神华	38,700	788,706.00	0.51
46	600309	万华化学	18,400	787,336.00	0.51
47	600690	海尔智家	43,100	745,199.00	0.48
48	002475	立讯精密	29,300	726,347.00	0.47
49	000338	潍柴动力	56,900	699,301.00	0.45
50	000568	泸州老窖	8,600	695,138.00	0.45
51	600340	华夏幸福	21,131	688,236.67	0.44
52	601012	隆基股份	29,780	688,215.80	0.44
53	600019	宝钢股份	105,200	683,800.00	0.44
54	600050	中国联通	110,300	679,448.00	0.44
55	601857	中国石油	93,800	645,344.00	0.42
56	002027	分众传媒	120,600	637,974.00	0.41
57	601989	中国重工	107,400	597,144.00	0.38
58	001979	招商蛇口	27,900	583,110.00	0.38
59	601628	中国人寿	20,400	577,728.00	0.37
60	002714	牧原股份	9,800	576,142.00	0.37
61	600999	招商证券	33,574	573,779.66	0.37
62	002230	科大讯飞	17,200	571,728.00	0.37
63	601390	中国中铁	87,600	571,152.00	0.37

64	601336	新华保险	10,300	566,809.00	0.36
65	601006	大秦铁路	69,700	563,873.00	0.36
66	601899	紫金矿业	144,000	542,880.00	0.35
67	000661	长春高新	1,600	540,800.00	0.35
68	601186	中国铁建	54,200	539,290.00	0.35
69	002594	比亚迪	10,600	537,632.00	0.35
70	000166	申万宏源	106,000	531,060.00	0.34
71	600570	恒生电子	7,510	511,806.50	0.33
72	000538	云南白药	6,100	508,862.00	0.33
73	002024	苏宁易购	43,800	502,824.00	0.32
74	600352	浙江龙盛	30,900	487,293.00	0.31
75	000776	广发证券	35,200	483,648.00	0.31
76	601669	中国电建	91,100	481,919.00	0.31
77	601998	中信银行	77,900	465,063.00	0.30
78	601933	永辉超市	45,200	461,492.00	0.30
79	300015	爱尔眼科	14,540	450,303.80	0.29
80	600958	东方证券	42,012	448,688.16	0.29
81	600926	杭州银行	53,500	445,655.00	0.29
82	601997	贵阳银行	50,600	437,690.00	0.28
83	000876	新希望	25,100	435,987.00	0.28
84	601225	陕西煤业	46,900	433,356.00	0.28
85	601838	成都银行	48,700	430,021.00	0.28
86	000100	TCL 集团	127,100	423,243.00	0.27
87	601155	新城控股	10,600	421,986.00	0.27
88	300142	沃森生物	14,400	408,384.00	0.26
89	600406	国电南瑞	21,700	404,488.00	0.26
90	600436	片仔癀	3,500	403,200.00	0.26
91	002202	金风科技	32,400	402,732.00	0.26
92	600741	华域汽车	18,500	399,600.00	0.26
93	600588	用友网络	14,560	391,372.80	0.25
94	002736	国信证券	28,900	380,324.00	0.24

95	600660	福耀玻璃	16,500	375,045.00	0.24
96	601377	兴业证券	54,900	370,026.00	0.24
97	000157	中联重科	60,300	362,403.00	0.23
98	600010	包钢股份	214,300	362,167.00	0.23
99	600547	山东黄金	8,700	358,179.00	0.23
100	000783	长江证券	45,400	354,574.00	0.23
101	600795	国电电力	136,000	345,440.00	0.22
102	002008	大族激光	10,000	343,800.00	0.22
103	601901	方正证券	48,300	343,413.00	0.22
104	600705	中航资本	63,200	342,544.00	0.22
105	601111	中国国航	35,100	335,907.00	0.22
106	000069	华侨城 A	48,200	334,990.00	0.22
107	600111	北方稀土	25,500	327,420.00	0.21
108	600703	三安光电	28,800	324,864.00	0.21
109	601108	财通证券	29,500	323,910.00	0.21
110	600011	华能国际	51,800	322,714.00	0.21
111	600438	通威股份	22,800	320,568.00	0.21
112	603993	洛阳钼业	80,700	319,572.00	0.21
113	600383	金地集团	26,600	317,338.00	0.20
114	600089	特变电工	43,600	316,100.00	0.20
115	600029	南方航空	40,500	312,660.00	0.20
116	601800	中国交建	27,600	312,432.00	0.20
117	600886	国投电力	39,800	309,246.00	0.20
118	002236	大华股份	21,100	306,372.00	0.20
119	601985	中国核电	54,900	305,244.00	0.20
120	002422	科伦药业	10,200	303,246.00	0.20
121	600271	航天信息	13,100	301,955.00	0.19
122	002007	华兰生物	9,900	301,851.00	0.19
123	601600	中国铝业	76,700	300,664.00	0.19
124	600196	复星医药	11,800	298,540.00	0.19
125	000895	双汇发展	11,900	296,191.00	0.19

126	600606	绿地控股	42,900	293,007.00	0.19
127	002001	新和成	15,100	291,279.00	0.19
128	300003	乐普医疗	12,600	290,052.00	0.19
129	600115	东方航空	46,100	289,047.00	0.19
130	601555	东吴证券	28,100	288,025.00	0.19
131	002311	海大集团	9,300	287,370.00	0.18
132	601577	长沙银行	29,800	284,292.00	0.18
133	600332	白云山	6,823	279,538.31	0.18
134	600061	国投资本	19,800	277,398.00	0.18
135	600109	国金证券	28,500	277,020.00	0.18
136	000963	华东医药	10,580	274,656.80	0.18
137	600221	海航控股	135,000	274,050.00	0.18
138	002044	美年健康	22,000	273,680.00	0.18
139	601788	光大证券	23,500	268,370.00	0.17
140	300124	汇川技术	11,708	268,230.28	0.17
141	600177	雅戈尔	42,200	267,970.00	0.17
142	000413	东旭光电	51,500	264,710.00	0.17
143	600522	中天科技	28,800	264,096.00	0.17
144	600487	亨通光电	15,600	261,456.00	0.17
145	002410	广联达	7,900	259,831.00	0.17
146	603019	中科曙光	7,400	259,740.00	0.17
147	000768	中航飞机	16,300	256,725.00	0.17
148	600018	上港集团	37,400	255,068.00	0.16
149	601618	中国中冶	83,800	254,752.00	0.16
150	600637	东方明珠	24,100	254,014.00	0.16
151	600100	同方股份	27,902	252,513.10	0.16
152	002352	顺丰控股	7,400	251,304.00	0.16
153	601607	上海医药	13,800	250,470.00	0.16
154	300033	同花顺	2,500	245,900.00	0.16
155	300017	网宿科技	22,800	245,784.00	0.16
156	000425	徐工机械	55,100	245,746.00	0.16

157	300122	智飞生物	5,600	241,360.00	0.16
158	600893	航发动力	10,600	240,726.00	0.15
159	300408	三环集团	12,300	239,235.00	0.15
160	002271	东方雨虹	10,500	237,930.00	0.15
161	601919	中远海控	46,800	234,936.00	0.15
162	600176	中国巨石	24,600	234,438.00	0.15
163	601877	正泰电器	10,100	233,209.00	0.15
164	600498	烽火通信	8,200	228,452.00	0.15
165	600516	方大炭素	18,531	227,745.99	0.15
166	601727	上海电气	42,300	227,574.00	0.15
167	300136	信维通信	9,100	222,495.00	0.14
168	600004	白云机场	12,200	222,040.00	0.14
169	600867	通化东宝	14,400	221,760.00	0.14
170	000728	国元证券	23,800	218,246.00	0.14
171	002460	赣锋锂业	9,200	215,556.00	0.14
172	000423	东阿阿胶	5,400	215,028.00	0.14
173	600809	山西汾酒	3,100	214,055.00	0.14
174	600023	浙能电力	47,800	211,276.00	0.14
175	002673	西部证券	20,600	207,648.00	0.13
176	600489	中金黄金	20,200	207,454.00	0.13
177	601018	宁波港	46,500	204,135.00	0.13
178	002241	歌尔股份	22,900	203,581.00	0.13
179	600068	葛洲坝	32,500	202,475.00	0.13
180	002466	天齐锂业	8,000	202,240.00	0.13
181	600066	宇通客车	15,500	201,810.00	0.13
182	002179	中航光电	5,990	200,425.40	0.13
183	300144	宋城演艺	8,500	196,690.00	0.13
184	300024	机器人	12,900	196,467.00	0.13
185	600170	上海建工	52,200	196,272.00	0.13
186	002081	金螳螂	18,800	193,828.00	0.12
187	601021	春秋航空	4,300	193,500.00	0.12

188	601198	东兴证券	16,200	192,456.00	0.12
189	600362	江西铜业	12,200	192,028.00	0.12
190	002146	荣盛发展	20,400	191,556.00	0.12
191	600482	中国动力	8,100	191,322.00	0.12
192	600398	海澜之家	21,000	190,470.00	0.12
193	002602	世纪华通	17,400	190,008.00	0.12
194	000961	中南建设	21,800	188,788.00	0.12
195	600085	同仁堂	6,500	188,500.00	0.12
196	600219	南山铝业	82,600	186,676.00	0.12
197	601881	中国银河	15,200	186,200.00	0.12
198	600674	川投能源	20,700	184,230.00	0.12
199	603156	养元饮品	4,956	183,768.48	0.12
200	000703	恒逸石化	13,400	183,044.00	0.12
201	000630	铜陵有色	74,300	182,778.00	0.12
202	002739	万达电影	9,800	180,712.00	0.12
203	000786	北新建材	9,900	179,487.00	0.12
204	002456	欧菲光	22,800	178,752.00	0.12
205	002493	荣盛石化	14,800	178,488.00	0.11
206	600535	天士力	10,674	176,654.70	0.11
207	002555	三七互娱	12,800	173,440.00	0.11
208	603986	兆易创新	2,000	173,400.00	0.11
209	000627	天茂集团	26,700	173,283.00	0.11
210	300070	碧水源	22,200	172,938.00	0.11
211	002050	三花智控	16,280	171,754.00	0.11
212	600297	广汇汽车	38,500	171,710.00	0.11
213	000629	攀钢钒钛	50,600	171,534.00	0.11
214	601138	工业富联	14,000	168,700.00	0.11
215	600663	陆家嘴	10,700	165,850.00	0.11
216	600369	西南证券	33,200	164,008.00	0.11
217	300296	利亚德	20,900	163,647.00	0.11
218	603833	欧派家居	1,500	161,430.00	0.10

219	603799	华友钴业	7,550	160,890.50	0.10
220	002624	完美世界	6,200	160,022.00	0.10
221	600208	新湖中宝	50,500	158,570.00	0.10
222	600118	中国卫星	6,900	155,595.00	0.10
223	000596	古井贡酒	1,300	154,063.00	0.10
224	002065	东华软件	22,000	153,780.00	0.10
225	603160	汇顶科技	1,100	152,680.00	0.10
226	000625	长安汽车	23,000	152,490.00	0.10
227	002508	老板电器	5,600	151,984.00	0.10
228	000656	金科股份	25,000	150,750.00	0.10
229	600346	恒力石化	12,360	150,297.60	0.10
230	000709	河钢股份	49,700	148,603.00	0.10
231	600153	建发股份	16,700	148,296.00	0.10
232	601992	金隅集团	39,100	147,016.00	0.09
233	601878	浙商证券	15,700	146,010.00	0.09
234	600583	海油工程	26,000	145,600.00	0.09
235	600760	中航沈飞	5,000	145,150.00	0.09
236	002032	苏泊尔	1,900	144,077.00	0.09
237	600027	华电国际	38,200	144,014.00	0.09
238	600038	中直股份	3,500	143,570.00	0.09
239	600977	中国电影	8,800	137,808.00	0.09
240	601117	中国化学	22,800	137,256.00	0.09
241	603858	步长制药	5,200	134,004.00	0.09
242	002153	石基信息	3,700	133,903.00	0.09
243	600688	上海石化	25,900	133,644.00	0.09
244	600415	小商品城	31,900	131,428.00	0.08
245	601216	君正集团	39,800	130,942.00	0.08
246	002558	巨人网络	7,160	130,097.20	0.08
247	600816	安信信托	25,700	129,785.00	0.08
248	000671	阳光城	18,900	122,472.00	0.08
249	002252	上海莱士	17,400	120,930.00	0.08

250	601238	广汽集团	10,800	118,044.00	0.08
251	601633	长城汽车	14,100	116,607.00	0.08
252	600188	兖州煤业	10,700	116,309.00	0.07
253	002010	传化智联	15,300	115,209.00	0.07
254	600566	济川药业	3,800	114,418.00	0.07
255	002310	东方园林	19,000	114,000.00	0.07
256	000402	金融街	14,000	109,760.00	0.07
257	002294	信立泰	4,900	109,662.00	0.07
258	601066	中信建投	5,200	109,616.00	0.07
259	600704	物产中大	20,200	109,484.00	0.07
260	300072	三聚环保	13,800	109,434.00	0.07
261	002120	韵达股份	3,440	106,020.80	0.07
262	002601	龙蟠佰利	7,100	105,293.00	0.07
263	603259	药明康德	1,200	104,016.00	0.07
264	601898	中煤能源	21,600	103,680.00	0.07
265	601360	三六零	4,800	102,624.00	0.07
266	002773	康弘药业	3,110	102,381.20	0.07
267	000898	鞍钢股份	26,820	101,647.80	0.07
268	300413	芒果超媒	2,400	98,520.00	0.06
269	000938	紫光股份	3,544	96,574.00	0.06
270	002411	延安必康	5,400	93,960.00	0.06
271	600372	中航电子	6,200	92,008.00	0.06
272	601228	广州港	22,000	91,960.00	0.06
273	002938	鹏鼎控股	3,100	91,016.00	0.06
274	002468	申通快递	3,600	89,784.00	0.06
275	600025	华能水电	21,300	86,691.00	0.06
276	000415	渤海租赁	21,600	84,672.00	0.05
277	600339	中油工程	19,700	83,134.00	0.05
278	600998	九州通	6,600	81,576.00	0.05
279	601162	天风证券	6,600	71,544.00	0.05
280	601808	中海油服	7,400	71,262.00	0.05

281	300251	光线传媒	10,300	70,040.00	0.05
282	002939	长城证券	4,000	66,760.00	0.04
283	002945	华林证券	3,500	64,750.00	0.04
284	300433	蓝思科技	9,200	64,124.00	0.04
285	002925	盈趣科技	1,600	62,416.00	0.04
286	000408	藏格控股	7,000	57,890.00	0.04
287	000553	安道麦A	5,400	57,888.00	0.04
288	600390	五矿资本	6,100	57,523.00	0.04
289	603260	合盛硅业	1,200	56,472.00	0.04
290	601828	美凯龙	4,600	55,890.00	0.04
291	600233	圆通速递	4,300	53,019.00	0.03
292	601298	青岛港	5,700	47,823.00	0.03
293	002625	光启技术	5,100	47,379.00	0.03
294	601212	白银有色	10,200	44,778.00	0.03
295	600299	安迪苏	4,100	42,517.00	0.03
296	600733	北汽蓝谷	4,900	40,474.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	10,837,889.18	6.97
2	600519	贵州茅台	5,464,257.00	3.52
3	600036	招商银行	4,621,460.00	2.97
4	000651	格力电器	3,021,221.00	1.94
5	000333	美的集团	2,925,370.00	1.88
6	601288	农业银行	2,545,118.00	1.64
7	000858	五粮液	2,326,490.59	1.50

8	600887	伊利股份	2,315,905.56	1.49
9	600276	恒瑞医药	2,277,851.00	1.47
10	600016	民生银行	2,205,005.00	1.42
11	600000	浦发银行	2,196,290.00	1.41
12	600030	中信证券	2,188,217.00	1.41
13	601398	工商银行	2,052,361.00	1.32
14	601988	中国银行	1,773,352.00	1.14
15	601601	中国太保	1,686,987.00	1.09
16	300498	温氏股份	1,665,196.80	1.07
17	000002	万科 A	1,660,919.00	1.07
18	601668	中国建筑	1,651,752.60	1.06
19	000001	平安银行	1,564,123.00	1.01
20	601169	北京银行	1,522,501.00	0.98

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	828,911.00	0.53
2	000895	双汇发展	490,513.00	0.32
3	600519	贵州茅台	429,490.00	0.28
4	300433	蓝思科技	396,299.00	0.25
5	002032	苏泊尔	393,910.00	0.25
6	600025	华能水电	372,772.00	0.24
7	600383	金地集团	371,747.00	0.24
8	601601	中国太保	363,206.00	0.23
9	601288	农业银行	349,272.00	0.22
10	601628	中国人寿	348,358.00	0.22
11	600000	浦发银行	335,976.00	0.22
12	601212	白银有色	334,266.00	0.22

13	601336	新华保险	328,934.00	0.21
14	601727	上海电气	324,131.00	0.21
15	601988	中国银行	323,634.00	0.21
16	601006	大秦铁路	306,296.00	0.20
17	600031	三一重工	303,309.00	0.20
18	600606	绿地控股	281,219.00	0.18
19	603288	海天味业	280,524.00	0.18
20	600036	招商银行	274,238.99	0.18

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	167,540,456.45
卖出股票收入（成交）总额	24,465,250.97

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	8,154,252.80	5.25
	其中：政策性金融债	8,154,252.80	5.25
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	8,154,252.80	5.25

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	108603	国开1804	42,830	4,285,569.80	2.76
2	108602	国开1704	38,300	3,868,683.00	2.49

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 贵州茅台（代码：600519.SH）为人保沪深300前十大持仓证券。2019年5月7日，贵州茅台酒股份有限公司收到上海证券交易所上市公司监管一部下发的《关于贵州茅台酒股份有限公司媒体报道相关事项的监管工作函》。有多篇媒体报道公司控股股东中国贵州茅台酒厂（集团）有限责任公司成立营销公司一事，投资者对此比较关注，根据上海证券交易所《股票上市规则》第17.1条的规定，公司被要求披露相关内容。格力电器（代码：000651）为人保沪深300前十大持仓证券。格力电器于2019年1月17日收到深圳证券交易所公司管理部下发的关注函。公司于2019年1月16日下午召开股东大会，公司董事长在股东大会上发表了“2018 年税后利润为 260 亿元”等有关公司业绩的言论，而公司当日晚间才对外披露业绩预告公告。深圳证券交易所《股票上市规则（2018 年修订）》第 2.15 条规定，上市公司及相关信息披露义务人在指定媒体上公告之前不得以新闻发布或答记者问等任何其他方式透露、泄漏未公开重大信息。公司董事长发表前述言论的时间早于公司在中国证监会指定媒体公告的时间。深圳证券交易所对此表示关注，并请公司严格规范董事、监事、高级管理人员对外发布信息的行为，切实提高信息

披露意识，遵守并促使有关人员遵守《股票上市规则》和深圳证券交易所其他相关规定。本基金投资贵州茅台、格力电器，投资决策程序符合公司投资制度的规定。除贵州茅台、格力电器外，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	25,633.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	139,065.76
5	应收申购款	153,804.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	318,503.61

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未存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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
4,237	36,170.45	132,087,999.81	86.19%	21,166,205.59	13.81%

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	351,866.08	0.23%

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年02月28日)基金份额总额	205,770,647.89
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	156,114,928.17
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	208,631,370.66
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	153,254,205.40

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

本报告期本基金管理人、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

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。目前事务所已提供审计服务从基金成立起至今。

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	133,516,990.35	69.54%	97,641.19	69.54%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

海通 证券	1	58,479,510.07	30.46%	42,766.17	30.46%	-
招商 证券	1	-	-	-	-	-
光大 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：

本基金本报告期内新增交易单元6个，其中长城、长江、中信建投、海通、招商、光大证券各1个。

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	-	-	10,000,000.00	50.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证	8,302,253.61	100.00%	-	-	-	-	-	-

券								
招商证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	10,000,000.00	50.00%	-	-	-	-

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	人保沪深300指数型证券投资基金基金份额发售公告、招募说明书、基金合同摘要	中国证券报、公司网站	2019-02-19
2	人保沪深300指数型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、公司网站	2019-03-01
3	人保沪深300指数型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	中国证券报、公司网站	2019-03-05
4	中国人保资产管理有限公司关于人保沪深300指数型证券投资基金参与部分销售机构费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2019-03-05
5	中国人保资产管理有限公司关于旗下基金新增中国银行股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、公司网站	2019-04-27
6	中国人保资产管理有限公司关于旗下基金参与中国银行股份有限公司定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2019-06-27

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过20%的时间区间					
机构	1	20190308 -20190627	0.00	29,999,000.00	-	29,999,000.00	19.57%
	2	20190308 -20190612	0.00	19,999,000.00	-	19,999,000.00	13.05%
	3	20190613 -20190630	0.00	61,417,750.03	-	61,417,750.03	40.08%

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沪深300指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《人保沪深300指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《人保沪深300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、报告期内人保沪深300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

二〇一九年八月二十四日