

---

# 人保中证 500 指数型证券投资基金

## 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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:2021 年 03 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3月24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。

本报告中财务资料经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计。

本报告期自2020年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	71
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	71
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	71
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	71

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
8.12 投资组合报告附注.....	71
§9 基金份额持有人信息.....	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	73
§10 开放式基金份额变动.....	73
§11 重大事件揭示.....	74
11.1 基金份额持有人大会决议.....	74
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
11.4 基金投资策略的改变.....	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8 其他重大事件.....	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	80
§13 备查文件目录.....	80
13.1 备查文件目录.....	80
13.2 存放地点.....	80
13.3 查阅方式.....	80

## § 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	29,742,545.77份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中国人保资产管理有限公司	交通银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	吕传红	陆志俊
	联系电话	010-69009696	95559
	电子邮箱	lvch@piccamc.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-820-7999	95559
传真		021-50765598	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大厦1198号20层、21层、 22层	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		北京市西城区西长安街88号 中国人保大厦8层	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		100031	200336
法定代表人		曾北川	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	中国人保资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大厦1198号20层、21层、22层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2020年	2019年	2018年12月07日(基金合同生效日)-2018年12月31日
本期已实现收益	33,570,559.73	17,075,758.06	118,181.30
本期利润	30,171,450.24	31,401,567.66	-4,829,400.84
加权平均基金份额本期利润	0.3541	0.3380	-0.0284
本期加权平均净值利润率	26.14%	30.03%	-2.88%
本期基金份额净值增长率	24.94%	26.79%	-4.45%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2020年末	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	15,278,522.32	31,405,646.04	-5,179,663.29
期末可供分配基金份额利润	0.5137	0.2115	-0.0445
期末基金资产净值	45,021,068.09	179,916,942.06	111,213,461.87
期末基金份额净值	1.5137	1.2115	0.9555
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2020年末	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	51.37%	21.15%	-4.45%

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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	3.27%	1.08%	2.70%	1.10%	0.57%	-0.02%
过去六个月	9.86%	1.36%	8.20%	1.38%	1.66%	-0.02%
过去一年	24.94%	1.51%	19.94%	1.54%	5.00%	-0.03%
自基金合同生效起至今	51.37%	1.42%	42.17%	1.45%	9.20%	-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指数型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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

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

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





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立至本报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

成立十余年来，人保资产以保险资金运用为主业，基于资产负债匹配管理理念，探索建立了从资产战略配置、资产战术配置、资产交易配置到集中交易和全流程风险管控

的资产管理价值链，并着眼于构建能够获得持续稳定收益的资产组合，坚持以绝对收益为核心的收益缺口管理原则，为委托人贡献了长期稳定的投资收益。

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

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

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

人保资产于2017年1月11日获得中国证监会《关于核准中国人保资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]107号），于2017年3月29日获得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。截至2020年12月31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证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保优势产业混合型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保福睿18个月定期开放债券型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金、人保利璟纯债债券型证券投资基金、人保中高等级信用债债券型证券投资基金、人保鑫选双债债券型证券投资基金、人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金(FOF)和人保量化锐进混合型发起式证券投资基金。

#### 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）	证券	说明

		期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
彬彬	基金经理	2020-04-02	-	10.5年	澳大利亚伍伦贡大学商学硕士。曾任中国人民财产保险股份有限公司资金运营部业务主办、主管。2017年11月加入中国人保资产管理公司公募基金事业部任基金经理助理。2019年1月15日起任人保优势产业混合型证券投资基金基金经理，自2020年4月2日起任人保沪深300指数型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金和人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理。
石晓冉	基金经理	2020-08-03	-	3年	北京师范大学数学学院统计学学士、概率论与数理统计学硕士。2017年7月至2018年8月在中信建投基金管理有限公司担任量化研究员，主要从事量化投资、研究工作。2018年8月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，历任量化研究员、基金经理助理，自2020年8月3日起任人保沪深300指数型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金和

					人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理，自2020年12月23日起任人保量化锐进混合型发起式证券投资基金基金经理。
刘笑明	基金经理	2018-12-07	2020-04-02	6年	北京大学化学学士、经济学学士，哥伦比亚大学运筹学硕士。曾任建信基金衍生品及量化投资部研究员、投资经理，北京极至投资管理有限公司投资经理。2017年6月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，2018年9月27日起至2020年4月2日任人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理，2018年12月7日起至2020年4月2日任人保中证500指数型证券投资基金基金经理，2019年2月28日起至2020年4月2日任人保沪深300指数型证券投资基金基金经理。

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。

3、2020年8月5日,公司发布了《人保中证500指数型证券投资基金基金经理变更公告》,自2020年8月3日起增聘石晓冉担任本基金的基金经理,上述事项已按规定在中国证券投资基金业协会办理变更手续,并报中国证监会北京证监局备案。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人严格执行《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。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各公募基金投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有公募基金投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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；5) 参与新股申购的收益等。

#### 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1.5137元，本报告期内，基金份额净值增长率为24.94%，同期业绩比较基准收益率为19.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年宏观经济在疫情的影响下，第一、二季度企业营收和盈利压力较大，在三季度业绩就有所好转。但是得益于中国出色的疫情防控能力，经济快速复苏，股票市场同样也取得了很好的表现。分行业看，医药、新能源汽车、白酒等板块2020年盈利和估价表现优异，成为A股增长的主力。

展望2021年，在经历了2020年市场较好的表现之后，股票市场有望在疫情后经济复苏的大背景下延续良好表现。随着上市公司利润改善、国内货币政策基调相对宽松、海外资本持续流入以及居民财富再配置的大背景下仍可对市场形成较强支撑，从而使市场的估值中枢得以维持并有望小幅抬升。同时，伴随国内经济结构性调整的深入，市场行情的演绎也有望出现相应的结构性变化，虽然收入体量较大、业绩稳定且市场份额较高的价值型公司仍将是投资者进行配置的核心标的，但具有业绩支撑的新兴产业高成长性公司将有可能随着风险偏好的逐步提升而获得超越市场平均水平的回报。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，主要采取了如下监察稽核工作：公司紧密跟踪法律法规和监管要求，防控各类合规风险，促进公司各项业务合法合规；进一步完善内部控制制度体系建设，对公募基金业务制度进行了全面的梳理，细化风险管理的相关规章制度及流程，进一步明确岗位职责及操作规程；开展多种形式的合规培训，重点加强了投资研究和基金销售业务条线的合规教育，不断提升员工的合规守法意识；强化事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，防范各类合规风险；公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督检查等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理、监控及提示，督促投研交易业务的合规开展；定期和不定期开展多项内部稽核，特别是对投资研究、基金交易等关键业务和岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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，成员主要由投资部门、研究部门、合规风控部门、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。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

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。

#### 4.10 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

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，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(21)第P00154号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	人保中证500指数型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了人保中证500指数型证券投资基金的财务报表，包括2020年12月31日的资产负债表，2020年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了人保中证500



	指数型证券投资基金2020年12月31日的财务状况、2020年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于人保中证500指数型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>中国人保资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括人保中证500指数型证券投资基金2020年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估人保中证500指数型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人

	<p>管理层计划清算人保中证500指数型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督人保中证500指数型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对人保中证500指数型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情</p>

	况可能导致人保中证500指数型证券投资基金不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	史曼	孙碧薇
会计师事务所的地址	上海市延安东路222号外滩中心30楼	
审计报告日期	2021-03-23	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	957,436.09	1,871,249.00
结算备付金		16,709.40	91,285.24
存出保证金		22,620.36	52,400.68
交易性金融资产	7.4.7.2	44,282,008.48	178,185,337.68
其中：股票投资		42,152,221.48	169,136,077.18
基金投资		-	-
债券投资		2,129,787.00	9,049,260.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		22,789.68	175,566.35
应收利息	7.4.7.5	47,213.23	186,222.06
应收股利		-	-
应收申购款		75,274.25	114,733.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		45,424,051.49	180,676,794.29
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	19.24
应付赎回款		251,399.30	500,495.58
应付管理人报酬		22,224.10	67,544.20
应付托管费		4,938.70	15,009.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	43,585.04	95,259.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	80,836.26	81,523.80
负债合计		402,983.40	759,852.23
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	29,742,545.77	148,511,296.02
未分配利润	7.4.7.10	15,278,522.32	31,405,646.04
所有者权益合计		45,021,068.09	179,916,942.06

负债和所有者权益总计		45,424,051.49	180,676,794.29
------------	--	---------------	----------------

注：报告截止日2020年12月31日，基金份额净值为人民币1.5137 元，基金份额总额29,742,545.77 份。

## 7.2 利润表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
<b>一、收入</b>		31,635,657.40	32,925,141.12
1. 利息收入		205,524.99	220,107.61
其中：存款利息收入	7.4.7.11	23,030.70	25,262.24
债券利息收入		182,494.29	194,845.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		34,693,681.83	18,194,677.06
其中：股票投资收益	7.4.7.12	33,624,425.64	17,369,858.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-71,596.09	-26,588.17
资产支持证券投资	7.4.7.13.	-	-
收益	3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,140,852.28	851,406.85

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,399,109.49	14,325,809.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	135,560.07	184,546.85
<b>减：二、费用</b>		1,464,207.16	1,523,573.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	523,718.07	469,740.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	116,381.80	104,386.86
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	510,164.94	623,006.72
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.02	0.02
7. 其他费用	7.4.7.20	313,942.33	326,439.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		30,171,450.24	31,401,567.66
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		30,171,450.24	31,401,567.66

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	148,511,296.02	31,405,646.04	179,916,942.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,171,450.24	30,171,450.24
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)	-118,768,750.25	-46,298,573.96	-165,067,324.21
其中：1. 基金申购款	60,108,938.30	21,778,102.68	81,887,040.98
2. 基金赎回款	-178,877,688.55	-68,076,676.64	-246,954,365.19
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)	29,742,545.77	15,278,522.32	45,021,068.09
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	116,393,125.16	-5,179,663.29	111,213,461.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,401,567.66	31,401,567.66
三、本期基金份额交易产生的基金	32,118,170.86	5,183,741.67	37,301,912.53

净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	181,149,702.73	23,748,154.24	204,897,856.97
2. 基金赎回款	-149,031,531.87	-18,564,412.57	-167,595,944.44
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）	148,511,296.02	31,405,646.04	179,916,942.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

曾北川

韩松

沈静

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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,本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央



行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款等）、货币市场工具、金融衍生工具（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权需缴纳的现金保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2020年12月31日的财务状况、2020年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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）。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。

本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值0.02%的年费率每日计算，逐日累计。每季度累计金额不足5万元的，按5万元计提，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，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。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.14 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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

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

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

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司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，对受让方不再缴纳印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	957,436.09	1,871,249.00
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	957,436.09	1,871,249.00

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	36,168,788.29	42,152,221.48	5,983,433.19	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,134,102.22	2,129,787.00	-4,315.22
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,134,102.22	2,129,787.00	-4,315.22

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	38,302,890.51	44,282,008.48	5,979,117.97
项目	上年度末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	159,741,792.85	169,136,077.18	9,394,284.33
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,065,317.37	9,049,260.50
	银行间市场	-	-
	合计	9,065,317.37	9,049,260.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	168,807,110.22	178,185,337.68	9,378,227.46

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有因买断式逆回购交易而取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	319.28	477.49



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	8.25	45.10
应收债券利息	46,874.59	185,673.51
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	11.11	25.96
合计	47,213.23	186,222.06

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	43,585.04	95,259.59
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	43,585.04	95,259.59

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	836.26	1,523.80
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	30,000.00	30,000.00
其他应付	50,000.00	50,000.00

合计	80,836.26	81,523.80
----	-----------	-----------

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	148,511,296.02	148,511,296.02
本期申购	60,108,938.30	60,108,938.30
本期赎回（以“-”号填列）	-178,877,688.55	-178,877,688.55
本期末	29,742,545.77	29,742,545.77

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。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,260,435.25	-4,854,789.21	31,405,646.04
本期利润	33,570,559.73	-3,399,109.49	30,171,450.24
本期基金份额交易产生的变动数	-46,008,738.25	-289,835.71	-46,298,573.96
其中：基金申购款	21,922,960.69	-144,858.01	21,778,102.68
基金赎回款	-67,931,698.94	-144,977.70	-68,076,676.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,822,256.73	-8,543,734.41	15,278,522.32

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	21,093.60	19,378.44
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	1,311.15	4,952.44

其他	625.95	931.36
合计	23,030.70	25,262.24

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	239,604,460.92	218,129,641.15
减：卖出股票成本总额	205,980,035.28	200,759,782.77
买卖股票差价收入	33,624,425.64	17,369,858.38

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-71,596.09	-26,588.17
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	-71,596.09	-26,588.17

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月 31日
卖出债券(、债转	14,712,836.17	15,300,987.59

股及债券到期兑付)成交总额		
减: 卖出债券(、 债转股及债券到期 兑付)成本总额	14,351,480.65	14,944,698.57
减: 应收利息总额	432,951.61	382,877.19
买卖债券差价收入	-71,596.09	-26,588.17

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,140,852.28	851,406.85
其中: 证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,140,852.28	851,406.85

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	-3,399,109.49	14,325,809.60

——股票投资	-3,410,851.14	14,341,466.47
——债券投资	11,741.65	-15,656.87
——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	-3,399,109.49	14,325,809.60

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	135,559.43	184,546.85
转换费收入	0.64	-
合计	135,560.07	184,546.85

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	510,164.94	623,006.72
银行间市场交易费用	-	-
合计	510,164.94	623,006.72

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	93,589.75
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	3,942.33	2,849.45
其他费用_指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	313,942.33	326,439.20

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
深圳市保腾盛基金管理有限公司	基金管理人控股公司
大成创新资本管理有限公司	基金管理人联营公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	523,718.07	469,740.66
其中：支付销售机构的客户维护费	73,576.27	27,181.00

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	116,381.80	104,386.86

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	7,199,000.00	19,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	12,800,000.00
报告期末持有的基金份额	7,199,000.00	7,199,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.20%	4.85%

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。



## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	957,436.09	21,093.60	1,871,249.00	19,378.44

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。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股流通受限	16.95	16.95	316	5,356.20	5,356.20	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股流通受限	15.18	15.18	336	5,100.48	5,100.48	-

003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股流通受限	15.27	15.27	285	4,351.95	4,351.95	-
--------	------	------------	------------	--------	-------	-------	-----	----------	----------	---

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300182	捷成股份	2020-12-30	重大事项	3.23	2021-01-07	3.40	16,405	68,891.74	52,988.15	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。

#### **7.4.13.2 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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	957,436.09	-	-	-	957,436.09
结算备付金	16,709.40	-	-	-	16,709.40
存出保证金	22,620.36	-	-	-	22,620.36
交易性金融资产	2,129,787.00	-	-	42,152,221.48	44,282,008.48
应收证券清算款	-	-	-	22,789.68	22,789.68
应收利息	-	-	-	47,213.23	47,213.23
应收申购款	-	-	-	75,274.25	75,274.25
资产总计	3,126,552.85	-	-	42,297,498.64	45,424,051.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	251,399.30	251,399.30
应付管理人报酬	-	-	-	22,224.10	22,224.10
应付托管费	-	-	-	4,938.70	4,938.70
应付交易费用	-	-	-	43,585.04	43,585.04
其他负债	-	-	-	80,836.26	80,836.26
负债总计	-	-	-	402,983.40	402,983.40

利率敏感度缺口	3,126,552.85	-	-	41,894,515.24	45,021,068.09
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,871,249.00	-	-	-	1,871,249.00
结算备付金	91,285.24	-	-	-	91,285.24
存出保证金	52,400.68	-	-	-	52,400.68
交易性金融资产	9,049,260.50	-	-	169,136,077.18	178,185,337.68
应收证券清算款	-	-	-	175,566.35	175,566.35
应收利息	-	-	-	186,222.06	186,222.06
应收申购款	-	-	-	114,733.28	114,733.28
资产总计	11,064,195.42	-	-	169,612,598.87	180,676,794.29
负债					
应付证券清算款	-	-	-	19.24	19.24
应付赎回款	-	-	-	500,495.58	500,495.58
应付管理人报酬	-	-	-	67,544.20	67,544.20
应付托管费	-	-	-	15,009.82	15,009.82
应付交易费用	-	-	-	95,259.59	95,259.59
其他负债	-	-	-	81,523.80	81,523.80
负债总计	-	-	-	759,852.23	759,852.23
利率敏感度缺	11,064,195.42	-	-	168,852,746.64	179,916,942.06

口					
---	--	--	--	--	--

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	1. 市场利率上升25个基点	-130.12	-9,996.12
	2. 市场利率下降25个基点	130.45	10,032.85

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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12月31日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例	公允价值	占基金 资产净 值比例

		(%)		(%)
交易性金融资产—股票投资	42,152,221.48	93.63	169,136,077.18	94.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	42,152,221.48	93.63	169,136,077.18	94.01

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险		
	Beta系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	1. 业绩比较基准增加5%	2,074,295.08	8,495,282.52
	2. 业绩比较基准减少5%	-2,074,295.08	-8,495,282.52

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、买入返售金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。



(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币42,084,424.70元，第二层次的余额为人民币2,197,583.78元，无第三层次的余额(于2019年12月31日：第一层次的余额为人民币168,779,838.61元，第二层次的余额为人民币9,247,346.03元，第三层次的余额为人民币158,153.04)。

(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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	42,152,221.48	92.80
	其中：股票	42,152,221.48	92.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,129,787.00	4.69
	其中：债券	2,129,787.00	4.69
	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	974,145.49	2.14
8	其他各项资产	167,897.52	0.37

9	合计	45,424,051.49	100.00
---	----	---------------	--------

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	471,072.00	1.05
B	采矿业	1,323,588.19	2.94
C	制造业	27,046,523.38	60.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	961,665.80	2.14
E	建筑业	595,049.59	1.32
F	批发和零售业	1,580,613.51	3.51
G	交通运输、仓储和邮政业	819,777.64	1.82
H	住宿和餐饮业	202,610.40	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,147,081.21	6.99
J	金融业	2,556,005.38	5.68
K	房地产业	1,213,366.29	2.70
L	租赁和商务服务业	417,824.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	386,452.00	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	389,721.50	0.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	33,763.84	0.07
Q	卫生和社会工作	378,748.00	0.84
R	文化、体育和娱乐业	348,007.46	0.77
S	综合	201,565.60	0.45
	合计	42,073,435.79	93.45

### 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	60,069.45	0.13
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	18,716.24	0.04
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	78,785.69	0.17

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	7,600	549,328.00	1.22
2	300012	华测检测	12,400	339,388.00	0.75
3	600426	华鲁恒升	8,514	317,572.20	0.71
4	002074	国轩高科	7,600	297,312.00	0.66
5	600089	特变电工	27,500	279,125.00	0.62
6	600079	人福医药	8,100	274,428.00	0.61
7	603882	金域医学	2,100	269,052.00	0.60
8	000547	航天发展	9,481	260,727.50	0.58
9	300285	国瓷材料	5,700	257,127.00	0.57
10	300207	欣旺达	8,200	251,822.00	0.56
11	300496	中科创达	2,132	249,444.00	0.55
12	002709	天赐材料	2,400	249,120.00	0.55
13	601233	桐昆股份	11,100	228,549.00	0.51
14	600143	金发科技	13,300	227,962.00	0.51
15	600739	辽宁成大	9,100	221,312.00	0.49
16	002185	华天科技	16,200	220,644.00	0.49
17	002797	第一创业	21,900	217,905.00	0.48
18	600132	重庆啤酒	1,800	214,182.00	0.48
19	002385	大北农	21,900	211,554.00	0.47
20	600885	宏发股份	3,900	211,458.00	0.47
21	002568	百润股份	2,000	208,580.00	0.46
22	601099	太平洋	50,900	207,672.00	0.46
23	601799	星宇股份	1,000	200,500.00	0.45
24	002340	格林美	28,600	199,914.00	0.44
25	603806	福斯特	2,300	196,420.00	0.44

26	688002	睿创微纳	1,700	188,700.00	0.42
27	300595	欧普康视	2,300	188,416.00	0.42
28	603589	口子窖	2,700	186,030.00	0.41
29	600486	扬农化工	1,400	184,800.00	0.41
30	600563	法拉电子	1,707	183,587.85	0.41
31	600316	洪都航空	3,200	181,984.00	0.40
32	601966	玲珑轮胎	5,152	181,195.84	0.40
33	000636	风华高科	5,300	178,610.00	0.40
34	002625	光启技术	8,000	178,000.00	0.40
35	300357	我武生物	2,300	176,410.00	0.39
36	601168	西部矿业	14,200	175,796.00	0.39
37	600529	山东药玻	3,500	175,525.00	0.39
38	600201	生物股份	8,400	175,476.00	0.39
39	603345	安井食品	900	173,583.00	0.39
40	002507	涪陵榨菜	4,100	173,430.00	0.39
41	300699	光威复材	1,900	169,195.00	0.38
42	600219	南山铝业	53,400	168,744.00	0.37
43	601997	贵阳银行	21,200	168,540.00	0.37
44	603816	顾家家居	2,380	167,813.80	0.37
45	002078	太阳纸业	11,600	167,388.00	0.37
46	000750	国海证券	28,400	166,424.00	0.37
47	002013	中航机电	14,449	165,441.05	0.37
48	300088	长信科技	18,300	162,687.00	0.36
49	600549	厦门钨业	9,600	161,760.00	0.36
50	600862	中航高科	5,200	156,520.00	0.35
51	002030	达安基因	4,546	155,927.80	0.35
52	600699	均胜电子	6,140	155,710.40	0.35
53	600884	杉杉股份	8,530	153,795.90	0.34
54	002131	利欧股份	50,300	152,409.00	0.34
55	002353	杰瑞股份	4,300	150,500.00	0.33
56	603486	科沃斯	1,693	149,813.57	0.33

57	603338	浙江鼎力	1,480	149,761.20	0.33
58	002465	海格通信	13,700	148,371.00	0.33
59	600460	士兰微	5,900	147,500.00	0.33
60	002212	天融信	6,964	146,313.64	0.32
61	002075	沙钢股份	13,200	144,804.00	0.32
62	000009	中国宝安	19,220	144,726.60	0.32
63	300316	晶盛机电	4,800	144,384.00	0.32
64	002791	坚朗五金	1,000	144,000.00	0.32
65	002500	山西证券	16,000	143,200.00	0.32
66	300146	汤臣倍健	5,900	142,485.00	0.32
67	600867	通化东宝	10,600	141,828.00	0.32
68	000630	铜陵有色	55,000	141,350.00	0.31
69	002683	宏大爆破	3,900	140,205.00	0.31
70	000988	华工科技	6,000	139,140.00	0.31
71	600511	国药股份	2,800	138,068.00	0.31
72	600038	中直股份	2,200	137,962.00	0.31
73	000998	隆平高科	6,900	136,689.00	0.30
74	600733	北汽蓝谷	15,600	135,252.00	0.30
75	300463	迈克生物	2,900	135,140.00	0.30
76	300168	万达信息	6,200	134,478.00	0.30
77	300482	万孚生物	1,500	133,815.00	0.30
78	300001	特锐德	4,500	132,120.00	0.29
79	002250	联化科技	5,500	131,945.00	0.29
80	600909	华安证券	16,200	129,600.00	0.29
81	300223	北京君正	1,400	128,086.00	0.28
82	603444	吉比特	300	127,800.00	0.28
83	300070	碧水源	16,500	126,225.00	0.28
84	002156	通富微电	5,000	126,200.00	0.28
85	002223	鱼跃医疗	4,450	125,534.50	0.28
86	000021	深科技	6,600	125,466.00	0.28
87	600779	水井坊	1,500	124,530.00	0.28

88	002444	巨星科技	4,000	124,440.00	0.28
89	600754	锦江酒店	2,400	123,672.00	0.27
90	601689	拓普集团	3,185	122,399.55	0.27
91	002572	索菲亚	4,725	122,377.50	0.27
92	002926	华西证券	9,800	122,304.00	0.27
93	002299	圣农发展	4,600	122,084.00	0.27
94	603866	桃李面包	2,060	121,746.00	0.27
95	300418	昆仑万维	6,100	121,695.00	0.27
96	002557	洽洽食品	2,252	121,270.20	0.27
97	603737	三棵树	800	121,200.00	0.27
98	600879	航天电子	16,200	121,176.00	0.27
99	600418	江淮汽车	9,900	121,077.00	0.27
100	600380	健康元	8,700	121,017.00	0.27
101	002080	中材科技	5,000	120,900.00	0.27
102	600516	方大炭素	17,000	120,190.00	0.27
103	002670	国盛金控	8,700	119,625.00	0.27
104	000039	中集集团	7,980	119,620.20	0.27
105	600155	华创阳安	9,047	119,329.93	0.27
106	688099	晶晨股份	1,500	118,095.00	0.26
107	002138	顺络电子	4,800	117,696.00	0.26
108	300271	华宇软件	4,870	116,246.90	0.26
109	002603	以岭药业	4,500	114,750.00	0.25
110	300024	机器人	9,300	114,390.00	0.25
111	000623	吉林敖东	6,918	113,939.46	0.25
112	000513	丽珠集团	2,800	113,400.00	0.25
113	002373	千方科技	5,900	112,808.00	0.25
114	002081	金螳螂	12,000	112,680.00	0.25
115	002966	苏州银行	14,600	112,128.00	0.25
116	600372	中航电子	5,700	112,005.00	0.25
117	600415	小商品城	20,300	111,853.00	0.25
118	300115	长盈精密	4,500	110,925.00	0.25

119	000878	云南铜业	7,609	110,102.23	0.24
120	300244	迪安诊断	3,200	109,696.00	0.24
121	600166	福田汽车	34,300	108,045.00	0.24
122	000050	深天马 A	7,300	107,602.00	0.24
123	000975	银泰黄金	12,360	106,419.60	0.24
124	601615	明阳智能	5,600	106,288.00	0.24
125	002273	水晶光电	9,098	105,445.82	0.23
126	300315	掌趣科技	20,600	105,266.00	0.23
127	600153	建发股份	12,800	105,088.00	0.23
128	600765	中航重机	4,200	105,000.00	0.23
129	002064	华峰氨纶	10,400	104,936.00	0.23
130	688088	虹软科技	1,500	104,880.00	0.23
131	300009	安科生物	7,130	104,668.40	0.23
132	300618	寒锐钴业	1,100	104,401.00	0.23
133	600801	华新水泥	5,060	104,387.80	0.23
134	002019	亿帆医药	5,500	104,115.00	0.23
135	600667	太极实业	11,000	103,950.00	0.23
136	000686	东北证券	10,450	102,619.00	0.23
137	000739	普洛药业	4,400	102,432.00	0.23
138	002511	中顺洁柔	4,900	102,263.00	0.23
139	600598	北大荒	5,300	102,025.00	0.23
140	002705	新宝股份	2,400	101,400.00	0.23
141	002920	德赛西威	1,200	100,968.00	0.22
142	002831	裕同科技	3,289	100,709.18	0.22
143	300017	网宿科技	14,600	100,594.00	0.22
144	600535	天士力	6,800	100,572.00	0.22
145	600170	上海建工	33,200	99,932.00	0.22
146	002124	天邦股份	6,800	99,280.00	0.22
147	603858	步长制药	4,300	99,201.00	0.22
148	000401	冀东水泥	7,000	99,050.00	0.22
149	600895	张江高科	5,800	98,832.00	0.22



150	000738	航发控制	4,300	98,599.00	0.22
151	000540	中天金融	31,300	98,595.00	0.22
152	000830	鲁西化工	7,600	97,128.00	0.22
153	603883	老百姓	1,540	96,758.20	0.21
154	002506	协鑫集成	22,700	96,475.00	0.21
155	603290	斯达半导	400	96,360.00	0.21
156	002195	二三四五	42,550	96,163.00	0.21
157	002152	广电运通	9,000	96,120.00	0.21
158	600642	申能股份	18,300	95,526.00	0.21
159	000690	宝新能源	13,000	94,900.00	0.21
160	600859	王府井	2,900	94,482.00	0.21
161	600409	三友化工	9,200	94,300.00	0.21
162	002648	卫星石化	3,600	94,032.00	0.21
163	600392	盛和资源	10,500	93,345.00	0.21
164	600008	首创股份	32,800	92,824.00	0.21
165	002056	横店东磁	6,100	92,659.00	0.21
166	601992	金隅集团	31,100	92,367.00	0.21
167	601456	国联证券	4,300	91,719.00	0.20
168	600497	驰宏锌锗	19,000	91,200.00	0.20
169	002382	蓝帆医疗	4,300	90,687.00	0.20
170	600580	卧龙电驱	5,800	90,480.00	0.20
171	002028	思源电气	4,500	90,270.00	0.20
172	002281	光迅科技	3,100	90,024.00	0.20
173	000060	中金岭南	18,600	89,652.00	0.20
174	603638	艾迪精密	1,300	89,622.00	0.20
175	000729	燕京啤酒	10,500	89,460.00	0.20
176	300058	蓝色光标	14,900	89,400.00	0.20
177	002595	豪迈科技	3,000	88,950.00	0.20
178	002690	美亚光电	2,001	88,604.28	0.20
179	300212	易华录	2,880	88,272.00	0.20
180	000807	云铝股份	11,719	88,244.07	0.20

181	002372	伟星新材	4,700	87,890.00	0.20
182	002294	信立泰	3,100	87,823.00	0.20
183	600827	百联股份	6,015	87,819.00	0.20
184	601866	中远海发	29,500	87,615.00	0.19
185	002221	东华能源	8,600	87,204.00	0.19
186	600315	上海家化	2,500	86,825.00	0.19
187	600528	中铁工业	9,900	86,526.00	0.19
188	000983	山西焦煤	15,270	86,122.80	0.19
189	002807	江阴银行	20,120	86,113.60	0.19
190	000581	威孚高科	3,700	85,803.00	0.19
191	600256	广汇能源	30,200	85,466.00	0.19
192	601717	郑煤机	7,800	85,254.00	0.19
193	300296	利亚德	13,300	84,588.00	0.19
194	000960	锡业股份	7,500	84,000.00	0.19
195	600908	无锡银行	13,800	83,904.00	0.19
196	002429	兆驰股份	13,500	83,700.00	0.19
197	000997	新大陆	5,450	83,276.00	0.18
198	600875	东方电气	8,300	82,751.00	0.18
199	600704	物产中大	18,900	82,593.00	0.18
200	600260	凯乐科技	7,500	81,750.00	0.18
201	300630	普利制药	1,950	81,685.50	0.18
202	600160	巨化股份	10,041	81,432.51	0.18
203	002396	星网锐捷	3,500	80,710.00	0.18
204	600811	东方集团	22,100	80,665.00	0.18
205	002745	木林森	5,500	80,245.00	0.18
206	600839	四川长虹	27,529	79,834.10	0.18
207	600728	佳都科技	10,500	79,695.00	0.18
208	600258	首旅酒店	3,720	78,938.40	0.18
209	002368	太极股份	3,020	78,852.20	0.18
210	002092	中泰化学	12,800	78,720.00	0.17
211	600515	海航基础	11,600	78,300.00	0.17

212	600325	华发股份	12,600	78,246.00	0.17
213	600737	中粮糖业	8,000	77,440.00	0.17
214	603317	天味食品	940	77,305.60	0.17
215	600167	联美控股	6,800	77,180.00	0.17
216	300474	景嘉微	1,100	76,901.00	0.17
217	600967	内蒙一机	6,300	76,608.00	0.17
218	600820	隧道股份	14,100	76,281.00	0.17
219	603927	中科软	1,900	76,171.00	0.17
220	000012	南玻A	10,248	75,630.24	0.17
221	002936	郑州银行	16,920	75,463.20	0.17
222	600881	亚泰集团	24,287	75,289.70	0.17
223	600597	光明乳业	4,600	74,796.00	0.17
224	002085	万丰奥威	11,400	74,784.00	0.17
225	300002	神州泰岳	14,600	74,606.00	0.17
226	601860	紫金银行	17,600	74,096.00	0.16
227	002839	张家港行	12,100	73,810.00	0.16
228	002390	信邦制药	8,700	73,776.00	0.16
229	002268	卫士通	4,400	73,480.00	0.16
230	002242	九阳股份	2,279	73,019.16	0.16
231	600446	金证股份	4,500	72,945.00	0.16
232	600410	华胜天成	8,224	72,864.64	0.16
233	600567	山鹰国际	24,000	72,480.00	0.16
234	002174	游族网络	5,500	72,380.00	0.16
235	000999	华润三九	2,900	72,326.00	0.16
236	600282	南钢股份	23,000	71,760.00	0.16
237	600928	西安银行	12,900	71,724.00	0.16
238	600804	鹏博士	10,653	71,588.16	0.16
239	603605	珀莱雅	400	71,200.00	0.16
240	000877	天山股份	4,700	70,970.00	0.16
241	603712	七一二	1,700	70,805.00	0.16
242	000709	河钢股份	31,600	70,784.00	0.16

243	601179	中国西电	15,300	70,533.00	0.16
244	600435	北方导航	7,802	70,218.00	0.16
245	000930	中粮科技	8,300	69,886.00	0.16
246	002387	维信诺	6,112	69,676.80	0.15
247	000629	攀钢钒钛	32,000	69,440.00	0.15
248	600273	嘉化能源	7,500	69,300.00	0.15
249	603000	人民网	4,100	69,290.00	0.15
250	300166	东方国信	6,300	68,985.00	0.15
251	001914	招商积余	3,200	68,896.00	0.15
252	600026	中远海能	10,300	68,804.00	0.15
253	000301	东方盛虹	7,200	68,256.00	0.15
254	600216	浙江医药	5,000	68,000.00	0.15
255	600060	海信视像	5,900	67,732.00	0.15
256	600718	东软集团	6,500	67,665.00	0.15
257	002233	塔牌集团	5,300	67,522.00	0.15
258	600188	兖州煤业	6,600	66,462.00	0.15
259	600037	歌华有线	7,210	66,332.00	0.15
260	000778	新兴铸管	17,900	65,872.00	0.15
261	000932	华菱钢铁	13,780	65,868.40	0.15
262	600064	南京高科	6,400	65,728.00	0.15
263	600572	康恩贝	13,900	65,469.00	0.15
264	600755	厦门国贸	9,800	65,464.00	0.15
265	002004	华邦健康	11,800	65,372.00	0.15
266	000400	许继电气	4,500	65,070.00	0.14
267	601005	重庆钢铁	43,700	64,676.00	0.14
268	000027	深圳能源	10,620	64,675.80	0.14
269	601975	招商南油	25,700	64,507.00	0.14
270	600039	四川路桥	14,300	64,493.00	0.14
271	002925	盈趣科技	1,000	64,330.00	0.14
272	000598	兴蓉环境	13,400	64,320.00	0.14
273	000887	中鼎股份	5,470	64,053.70	0.14

274	002128	露天煤业	5,780	63,233.20	0.14
275	603198	迎驾贡酒	1,800	62,820.00	0.14
276	002701	奥瑞金	12,600	62,244.00	0.14
277	000089	深圳机场	7,600	62,092.00	0.14
278	600398	海澜之家	9,600	61,632.00	0.14
279	300026	红日药业	13,450	61,601.00	0.14
280	000825	太钢不锈	17,000	61,370.00	0.14
281	600158	中体产业	5,000	61,300.00	0.14
282	601106	中国一重	20,500	61,295.00	0.14
283	002110	三钢闽光	9,100	61,243.00	0.14
284	601118	海南橡胶	12,700	61,214.00	0.14
285	002191	劲嘉股份	6,600	60,918.00	0.14
286	002563	森马服饰	6,000	60,120.00	0.13
287	300072	三聚环保	10,504	59,662.72	0.13
288	000970	中科三环	6,300	59,535.00	0.13
289	600120	浙江东方	9,945	59,371.65	0.13
290	600171	上海贝岭	4,200	58,884.00	0.13
291	603228	景旺电子	1,947	58,702.05	0.13
292	002867	周大生	2,200	58,630.00	0.13
293	000488	晨鸣纸业	9,100	58,422.00	0.13
294	600195	中牧股份	4,544	58,208.64	0.13
295	600022	山东钢铁	40,660	58,143.80	0.13
296	002985	北摩高科	300	57,990.00	0.13
297	000090	天健集团	9,742	57,867.48	0.13
298	601699	潞安环能	8,900	57,850.00	0.13
299	000967	盈峰环境	7,100	57,794.00	0.13
300	002048	宁波华翔	3,697	57,562.29	0.13
301	000402	金融街	8,909	57,463.05	0.13
302	600056	中国医药	4,000	57,320.00	0.13
303	002217	合力泰	13,900	56,990.00	0.13
304	600376	首开股份	9,700	56,939.00	0.13

305	600673	东阳光	11,300	56,839.00	0.13
306	300133	华策影视	9,180	56,732.40	0.13
307	000528	柳 工	7,700	56,672.00	0.13
308	000883	湖北能源	14,500	56,260.00	0.12
309	603077	和邦生物	39,600	56,232.00	0.12
310	600507	方大特钢	8,098	56,200.12	0.12
311	601333	广深铁路	25,300	56,166.00	0.12
312	000990	诚志股份	4,700	55,742.00	0.12
313	600006	东风汽车	5,900	55,696.00	0.12
314	600021	上海电力	7,800	55,536.00	0.12
315	688321	微芯生物	1,500	55,515.00	0.12
316	000563	陕国投 A	14,700	55,419.00	0.12
317	688029	南微医学	300	55,203.00	0.12
318	601200	上海环境	5,051	55,055.90	0.12
319	600970	中材国际	8,000	55,040.00	0.12
320	300376	易事特	6,900	54,924.00	0.12
321	601000	唐山港	22,100	54,808.00	0.12
322	000685	中山公用	6,600	54,780.00	0.12
323	002203	海亮股份	7,407	54,737.73	0.12
324	600782	新钢股份	11,900	54,621.00	0.12
325	000898	鞍钢股份	17,900	54,416.00	0.12
326	300180	华峰超纤	9,200	54,372.00	0.12
327	600500	中化国际	10,300	54,281.00	0.12
328	002266	浙富控股	12,000	54,000.00	0.12
329	002317	众生药业	4,900	53,998.00	0.12
330	603568	伟明环保	2,820	53,382.60	0.12
331	002948	青岛银行	9,000	53,370.00	0.12
332	002244	滨江集团	11,600	53,244.00	0.12
333	002155	湖南黄金	6,248	53,170.48	0.12
334	300113	顺网科技	3,100	53,165.00	0.12
335	300182	捷成股份	16,405	52,988.15	0.12

336	600126	杭钢股份	10,000	52,900.00	0.12
337	000559	万向钱潮	9,783	52,339.05	0.12
338	000758	中色股份	10,300	52,324.00	0.12
339	601098	中南传媒	5,490	52,319.70	0.12
340	600466	蓝光发展	11,300	52,319.00	0.12
341	000519	中兵红箭	5,200	52,104.00	0.12
342	601598	中国外运	11,800	51,920.00	0.12
343	601865	福莱特	1,300	51,870.00	0.12
344	601608	中信重工	12,983	51,412.68	0.11
345	600373	中文传媒	5,094	51,398.46	0.11
346	600266	城建发展	10,072	51,165.76	0.11
347	601016	节能风电	14,900	51,107.00	0.11
348	600649	城投控股	9,400	51,042.00	0.11
349	300010	豆神教育	5,200	50,752.00	0.11
350	600348	阳泉煤业	9,000	50,490.00	0.11
351	600073	上海梅林	4,902	50,441.58	0.11
352	000028	国药一致	1,101	50,425.80	0.11
353	600546	山煤国际	5,900	50,209.00	0.11
354	603885	吉祥航空	4,400	50,028.00	0.11
355	601718	际华集团	16,400	49,692.00	0.11
356	600959	江苏有线	15,000	49,650.00	0.11
357	000078	海王生物	12,300	49,323.00	0.11
358	002458	益生股份	4,400	49,060.00	0.11
359	600901	江苏租赁	8,900	49,039.00	0.11
360	002183	怡亚通	11,140	48,570.40	0.11
361	002505	大康农业	19,000	48,070.00	0.11
362	600388	龙净环保	5,400	47,952.00	0.11
363	002640	跨境通	9,300	47,802.00	0.11
364	002399	海普瑞	2,771	47,716.62	0.11
365	002249	大洋电机	10,600	47,700.00	0.11
366	600808	马钢股份	17,900	47,614.00	0.11

367	600094	大名城	11,844	47,612.88	0.11
368	002440	闰土股份	5,100	47,532.00	0.11
369	600062	华润双鹤	3,960	47,480.40	0.11
370	600633	浙数文化	5,800	47,212.00	0.10
371	600645	中源协和	2,400	47,064.00	0.10
372	600835	上海机电	2,400	46,704.00	0.10
373	002038	双鹭药业	4,600	46,460.00	0.10
374	002468	申通快递	4,600	46,368.00	0.10
375	000564	供销大集	17,900	46,361.00	0.10
376	600141	兴发集团	4,200	46,326.00	0.10
377	600675	中华企业	13,600	45,696.00	0.10
378	000959	首钢股份	11,900	45,577.00	0.10
379	600643	爱建集团	6,000	45,120.00	0.10
380	601778	晶科科技	6,200	45,012.00	0.10
381	601958	金钼股份	7,200	44,712.00	0.10
382	000158	常山北明	7,200	44,640.00	0.10
383	002434	万里扬	5,000	44,600.00	0.10
384	600863	内蒙华电	17,300	44,461.00	0.10
385	000415	渤海租赁	18,500	44,400.00	0.10
386	601880	大连港	23,000	44,390.00	0.10
387	002408	齐翔腾达	5,300	44,308.00	0.10
388	002010	传化智联	9,300	43,803.00	0.10
389	002544	杰赛科技	2,600	43,628.00	0.10
390	000869	张裕 A	1,000	43,600.00	0.10
391	600312	平高电气	6,100	43,554.00	0.10
392	600729	重庆百货	1,502	43,407.80	0.10
393	000826	启迪环境	6,400	43,264.00	0.10
394	600717	天津港	8,988	42,962.64	0.10
395	601611	中国核建	5,900	42,952.00	0.10
396	600776	东方通信	3,600	42,660.00	0.09
397	000031	大悦城	9,567	42,094.80	0.09



398	300459	金科文化	13,140	41,916.60	0.09
399	002583	海能达	6,800	41,752.00	0.09
400	002424	贵州百灵	5,300	41,499.00	0.09
401	002635	安洁科技	2,400	41,352.00	0.09
402	002589	瑞康医药	7,900	41,317.00	0.09
403	002002	鸿达兴业	13,600	40,800.00	0.09
404	600566	济川药业	2,000	40,460.00	0.09
405	603650	彤程新材	1,300	40,300.00	0.09
405	000681	视觉中国	3,100	40,300.00	0.09
407	000501	鄂武商 A	3,407	39,691.55	0.09
408	600259	广晟有色	1,300	39,221.00	0.09
409	600648	外高桥	2,800	39,116.00	0.09
410	300324	旋极信息	9,200	38,916.00	0.09
411	000718	苏宁环球	11,300	38,759.00	0.09
412	600307	酒钢宏兴	23,300	38,445.00	0.09
413	000717	韶钢松山	9,000	38,430.00	0.09
414	600131	国网信通	2,700	38,421.00	0.09
415	603708	家家悦	1,800	38,340.00	0.09
416	600823	世茂股份	8,300	38,263.00	0.08
417	000046	泛海控股	11,600	38,048.00	0.08
418	600582	天地科技	12,300	37,884.00	0.08
419	600339	中油工程	12,200	37,576.00	0.08
420	002815	崇达技术	2,600	37,544.00	0.08
421	002375	亚厦股份	5,000	37,200.00	0.08
422	000008	神州高铁	14,500	36,830.00	0.08
423	000156	华数传媒	4,300	36,808.00	0.08
424	600329	中新药业	2,100	36,792.00	0.08
425	600985	淮北矿业	3,249	36,356.31	0.08
426	600968	海油发展	15,100	36,089.00	0.08
427	601928	凤凰传媒	5,700	36,081.00	0.08
428	600664	哈药股份	11,300	36,047.00	0.08

429	000061	农产品	5,100	35,955.00	0.08
430	300257	开山股份	2,600	35,490.00	0.08
431	000543	皖能电力	8,400	35,112.00	0.08
432	002416	爱施德	4,680	34,912.80	0.08
433	600556	天下秀	2,700	34,155.00	0.08
434	600748	上实发展	6,900	33,879.00	0.08
435	603377	东方时尚	1,744	33,763.84	0.07
436	603260	合盛硅业	1,000	33,440.00	0.07
437	601298	青岛港	5,200	33,436.00	0.07
438	002302	西部建设	3,800	33,364.00	0.07
439	000937	冀中能源	8,000	33,280.00	0.07
440	603515	欧普照明	1,100	33,231.00	0.07
441	600869	智慧能源	8,200	32,718.00	0.07
442	601127	小康股份	1,900	32,452.00	0.07
443	600639	浦东金桥	2,515	31,186.00	0.07
444	601139	深圳燃气	4,300	31,132.00	0.07
445	601228	广州港	9,200	30,912.00	0.07
445	002503	搜于特	13,800	30,912.00	0.07
447	600277	亿利洁能	10,200	30,498.00	0.07
448	600787	中储股份	6,600	30,426.00	0.07
449	603888	新华网	1,600	30,400.00	0.07
450	300134	大富科技	2,900	29,957.00	0.07
451	000600	建投能源	5,300	29,733.00	0.07
452	000813	德展健康	6,700	29,681.00	0.07
453	603225	新凤鸣	2,120	29,468.00	0.07
454	600640	号百控股	2,400	29,400.00	0.07
454	600545	卓郎智能	8,400	29,400.00	0.07
456	600350	山东高速	4,700	29,046.00	0.06
457	600517	国网英大	4,700	28,576.00	0.06
458	000062	深圳华强	2,280	28,363.20	0.06
459	601828	美凯龙	3,300	28,017.00	0.06

460	600291	西水股份	4,900	27,783.00	0.06
461	600871	石化油服	14,100	27,636.00	0.06
462	002093	国脉科技	3,699	26,965.71	0.06
463	600575	淮河能源	11,600	26,912.00	0.06
464	002419	天虹股份	3,519	26,885.16	0.06
465	603056	德邦股份	2,100	26,649.00	0.06
466	002051	中工国际	3,679	26,084.11	0.06
467	000537	广宇发展	4,140	25,957.80	0.06
468	600657	信达地产	6,400	25,920.00	0.06
469	603379	三美股份	1,320	25,212.00	0.06
470	000553	安道麦A	3,200	25,024.00	0.06
471	601869	长飞光纤	900	24,336.00	0.05
472	600623	华谊集团	4,185	24,273.00	0.05
473	603328	依顿电子	3,019	24,001.05	0.05
474	600707	彩虹股份	3,500	23,310.00	0.05
475	002946	新乳业	1,300	22,893.00	0.05
476	600338	西藏珠峰	2,160	22,636.80	0.05
477	002901	大博医疗	300	22,119.00	0.05
478	603893	瑞芯微	300	21,705.00	0.05
479	601801	皖新传媒	4,501	21,379.75	0.05
480	600903	贵州燃气	1,660	21,082.00	0.05
481	002653	海思科	1,200	21,024.00	0.05
482	603983	丸美股份	400	20,884.00	0.05
483	603786	科博达	300	20,286.00	0.05
484	601003	柳钢股份	3,800	19,722.00	0.04
485	600053	九鼎投资	1,000	19,550.00	0.04
486	603868	飞科电器	400	18,712.00	0.04
487	603355	莱克电气	600	18,138.00	0.04
488	603719	良品铺子	300	17,601.00	0.04
489	601969	海南矿业	2,900	17,342.00	0.04
490	002818	富森美	1,120	15,825.60	0.04

491	002941	新疆交建	1,400	15,400.00	0.03
492	002423	中粮资本	1,400	13,552.00	0.03
493	001872	招商港口	800	12,736.00	0.03
494	002957	科瑞技术	600	12,270.00	0.03
495	601512	中新集团	1,200	11,928.00	0.03
496	600917	重庆燃气	1,400	9,604.00	0.02
497	601068	中铝国际	2,000	7,120.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.04
2	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.04
3	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.04
4	605155	N西大门	350	10,668.00	0.02
5	605277	新亚电子	316	5,356.20	0.01
6	003030	祖名股份	336	5,100.48	0.01
7	003031	中瓷电子	285	4,351.95	0.01

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002185	华天科技	1,519,995.00	0.84
2	300558	贝达药业	1,130,574.00	0.63
3	600529	山东药玻	1,009,176.00	0.56
4	300496	中科创达	882,139.20	0.49

5	300482	万孚生物	851,110.00	0.47
6	300357	我武生物	849,413.00	0.47
7	300212	易华录	821,019.00	0.46
8	002138	顺络电子	809,217.00	0.45
9	300271	华宇软件	790,896.00	0.44
10	002557	洽洽食品	772,766.73	0.43
11	300017	网宿科技	740,389.00	0.41
12	300595	欧普康视	723,780.00	0.40
13	300024	机器人	716,601.00	0.40
14	300070	碧水源	704,835.00	0.39
15	002156	通富微电	687,007.00	0.38
16	002511	中顺洁柔	671,126.00	0.37
17	002396	星网锐捷	638,384.00	0.35
18	600153	建发股份	630,843.00	0.35
19	000630	铜陵有色	614,133.00	0.34
20	600535	天士力	606,729.00	0.34

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002821	凯莱英	1,807,717.00	1.00
2	600745	闻泰科技	1,705,018.00	0.95
3	300014	亿纬锂能	1,685,739.16	0.94
4	300253	卫宁健康	1,631,874.00	0.91
5	002371	北方华创	1,570,903.00	0.87
6	002463	沪电股份	1,525,918.04	0.85
7	002049	紫光国微	1,452,768.00	0.81
8	300383	光环新网	1,426,393.00	0.79
9	002185	华天科技	1,379,701.01	0.77

10	600739	辽宁成大	1,371,016.00	0.76
11	600584	长电科技	1,355,550.00	0.75
12	002384	东山精密	1,347,562.00	0.75
13	300012	华测检测	1,290,987.00	0.72
14	600763	通策医疗	1,287,517.00	0.72
15	002129	中环股份	1,286,358.00	0.71
16	002439	启明星辰	1,278,111.24	0.71
17	300529	健帆生物	1,207,431.60	0.67
18	002127	南极电商	1,185,546.00	0.66
19	600201	生物股份	1,182,210.00	0.66
20	002812	恩捷股份	1,159,092.00	0.64

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	82,407,030.72
卖出股票收入（成交）总额	239,604,460.92

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,129,787.00	4.73
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)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	2,129,787.00	4.73

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019627	20国债01	21,300	2,129,787.00	4.73

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 国轩高科（代码：002074）为本基金前十大持仓证券。2020年7月15日公司发布公告收到中国证券监督管理委员会江苏监管局的《关于对国轩高科股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2020]60号），该决定指出公司存在如下违规行为：第一、非经营性资金占用；第二、未按规定程序改变募集资金用途；第三、未在规定期限内披露业绩预告。中国证券监督管理委员会江苏监管局决定对国轩高科采取改正的监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。2020年11月2日公司发布公告收到深圳证券交易所的《关

于对国轩高科股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》。该决定指出公司存在如下违规行为：一、控股股东非经营性资金占用；二、违规使用募集资金；三、未在规定期限内披露业绩预告；四、政府补助披露不及时。鉴于上述违规事实及情节，深圳证券交易所对于国轩高科股份有限公司及相关当事人给予通报批评的处分。本基金投资国轩高科投资决策程序符合公司投资制度的规定。除国轩高科，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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	22,620.36
2	应收证券清算款	22,789.68
3	应收股利	-
4	应收利息	47,213.23
5	应收申购款	75,274.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	167,897.52

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	占基	流通受限情况说明
----	------	------	----------	----	----------



			允价值	金资 产净 值比 例 (%)	
1	605277	新亚电子	5,356.20	0.01	新股未上市

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
6,023	4,938.16	7,199,000.00	24.20%	22,543,545.77	75.80%

### 9.2 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	40,801.84	0.14%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年12月07日)基金份额总额	255,386,460.94
本报告期期初基金份额总额	148,511,296.02

本报告期基金总申购份额	60,108,938.30
减：本报告期基金总赎回份额	178,877,688.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,742,545.77

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人股东中国人民保险集团股份有限公司于2020年12月21日决定，罗熹兼任中国人保资产管理有限公司非执行董事、董事长，相关任职资格目前在办理过程中。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

### 11.5 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。本基金本报告期内应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的基金审计费用为4万元整。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	30,718,341.74	9.66%	22,464.62	9.66%	-
光大证券	1	94,788,101.03	29.80%	69,317.93	29.80%	-
海通证券	1	35,845,593.03	11.27%	26,214.35	11.27%	-
兴业证券	1	11,057,270.76	3.48%	8,086.41	3.48%	-
招商证券	1	94,628,642.37	29.75%	69,202.33	29.75%	-
中信建投	1	51,082,372.84	16.06%	37,356.51	16.06%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,264,866.50	7.62%	-	-	-	-	-	-
光大证券	10,706,073.00	64.53%	-	-	-	-	-	-
海通证	3,982,830.69	24.01%	-	-	-	-	-	-

券								
兴业证 券	352,905.00	2.13%	-	-	-	-	-	-
招商证 券	283,481.12	1.71%	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

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交易单元。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-01-02
2	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金开展直销渠道赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-02-18
3	中国人保资产管理有限公司	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-03

	关于旗下部分基金在中国银行股份有限公司开通基金转换业务的公告		
4	中国人保资产管理有限公司旗下部分基金年度报告提示性公告，人保中证500指数型证券投资基金2019年年度报告，2019年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-25
5	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金开展网上直销费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-03-31
6	人保中证500指数型证券投资基金恢复大额申购、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-07
7	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金在北京汇成基金销售有限公司开通定投并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-08
8	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金在北京蛋卷基金销售有限公司开通定投并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-08
9	人保中证500指数型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-08
10	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订基金合同、托管协议的提示性公告，人保中证500指数型证券投资基金基金合同（更新），人保中证500指数型证券投资	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10

	基金托管协议（更新）		
11	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书更新的提示性公告，人保中证500指数型证券投资基金招募说明书（更新），人保中证500指数型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-10
12	中国人保资产管理有限公司旗下基金2020年1季度报告提示性公告，人保中证500指数型证券投资基金2020年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-22
13	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金在江苏汇林保大基金销售有限公司开通定投并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-04-28
14	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金在北京百度百盈基金销售有限公司开通定投并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-05-30
15	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金新增安信证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-06
16	中国人保资产管理有限公司旗下基金2020年2季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-21
17	人保中证500指数型证券投资基金2020年第二季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-07-21
18	关于旗下部分基金新增中国	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-01

	人寿保险股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告		
19	人保中证500指数型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-05
20	关于部分基金招募说明书更新的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-08
21	人保中证500指数型证券投资基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-08
22	人保中证500指数型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-08
23	中国人保资产管理有限公司旗下部分基金中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-31
24	人保中证500指数型证券投资基金2020年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-31
25	人保中证500指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2020-08-31
26	中国人保资产管理有限公司旗下基金2020年3季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-28
27	人保中证500指数型证券投资基金2020年第三季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020-10-28
28	中国人保资产管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投	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	持有基金份额比	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

资 者 类 别	号	例达到或者超过 20%的时间区间					
机 构	1	20201211-20201 231	7,199,000.00	-	0.00	7,199,000.00	24.20%
	2	20200220-20200 303, 20200305-2 0201210	25,836,706.57	-	25,836,706.57	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

### 13.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区西长安街88号中国人保大厦



基金托管人办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

二〇二一年三月三十一日