
人保中证 500 指数型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	59
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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61

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	61
§9 开放式基金份额变动	61
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 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	24,889,403.50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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国人保资产管理有 限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大厦1198号2 0层、21层、22层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
	（2021年01月01日- 2021年06月30日）

本期已实现收益	4,315,689.32
本期利润	3,078,677.37
加权平均基金份额本期利润	0.1181
本期加权平均净值利润率	7.67%
本期基金份额净值增长率	7.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	15,628,328.12
期末可供分配基金份额利润	0.6279
期末基金资产净值	40,517,731.62
期末基金份额净值	1.6279
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	62.79%

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	1.67%	0.70%	1.12%	0.69%	0.55%	0.01%
过去三个月	9.69%	0.66%	8.41%	0.65%	1.28%	0.01%
过去六个月	7.54%	0.95%	6.61%	0.94%	0.93%	0.01%
过去一年	18.15%	1.18%	15.35%	1.19%	2.80%	-0.01%

自基金合同生效起至今	62.79%	1.34%	51.57%	1.37%	11.22%	-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
(2018年12月07日-2021年06月30日)



- 注：1、本基金基金合同于2018年12月7日生效。根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月，建仓期满，本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。
- 2、本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中国人保资产管理有限公司（简称人保资产）成立于2003年7月16日，是经国务院同意、原中国保监会批准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。

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》。人保资产公募基金产品线逐渐丰富，涵盖了股票指数型、债券型、混合型、货币型等产品。截至2021年6月30日，人保资产旗下管理的公募基金产品包括人保货币市场基金、人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保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、人保行业轮动混合型证券投资基金、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等。

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	证	说明
----	----	--------	---	----

		金经理（助理） 期限		券 从 业 年 限	
		任职 日期	离任 日期		
石晓 冉	基金经理	2020- 08-03	-	4 年	北京师范大学统计学硕士。曾任中信建投基金管理有限公司量化研究员。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，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，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。
彬彬	基金经理	2020- 04-02	2021- 05-25	11 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，历任基金经理助理，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，2020年4月2日至2021年5月25日任人保沪深300指数型证券投资基金、人保中证500指数

					型证券投资基金、人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为本基金合同生效日。

2、非首任基金经理，其“任职日期”为公告确定的聘任日期。

3、2021年5月27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2021年5月25日起解聘彬彬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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保中证500基金份额净值为1.6279元，本报告期内，基金份额净值增长率为7.54%，同期业绩比较基准收益率为6.61%。

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2021年下半年，管理人对于市场的判断依然比较乐观，宏观上“紧信用”的背景下，“宽货币”应该是保证前提，市场出现系统性风险的概率不大，风格上认为成长风格占优的趋势仍将持续。

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。会计师事务所在管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值委员会，成员主要由投资部门、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验。基金经理列席会议，但不参与具体决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人已与中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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金自2021年1月1日至2021年6月30日连续118个工作日净值低于5000万，公司正在完善相关方案。本报告期内本基金未出现连续20个工作日基金持有人数不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，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基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由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中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	942,090.11	957,436.09
结算备付金		-	16,709.40
存出保证金		14,661.41	22,620.36
交易性金融资产	6.4.7.2	39,902,067.34	44,282,008.48
其中：股票投资		38,118,067.34	42,152,221.48
基金投资		-	-
债券投资		1,784,000.00	2,129,787.00
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		13,834.18	22,789.68
应收利息	6.4.7.5	36,979.82	47,213.23
应收股利		-	-
应收申购款		91,352.68	75,274.25
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		41,000,985.54	45,424,051.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		339,083.49	251,399.30
应付管理人报酬		14,840.48	22,224.10
应付托管费		3,297.85	4,938.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	16,000.33	43,585.04
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	110,031.77	80,836.26
负债合计		483,253.92	402,983.40
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	24,889,403.50	29,742,545.77
未分配利润	6.4.7.9	15,628,328.12	15,278,522.32

所有者权益合计		40,517,731.62	45,021,068.09
负债和所有者权益总计		41,000,985.54	45,424,051.49

注：报告截止日2021年6月30日，基金份额24,889,403.50份，份额净值1.6279元。

6.2 利润表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		3,391,264.58	18,710,083.77
1. 利息收入		22,336.92	143,336.42
其中：存款利息收入	6.4.7.10	3,527.15	13,981.82
债券利息收入		18,809.77	129,354.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,590,350.89	15,805,892.13
其中：股票投资收益	6.4.7.11	4,261,442.60	15,011,272.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-4,102.22	-18,286.56
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	333,010.51	812,905.85
3. 公允价值变动收益（损	6.4.7.16	-1,237,011.95	2,682,883.88

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 17	15, 588. 72	77, 971. 34
减: 二、费用		312, 587. 21	885, 861. 08
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	89, 675. 50	324, 548. 65
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	19, 927. 84	72, 121. 93
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	42, 556. 50	312, 449. 02
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0. 02
7. 其他费用	6. 4. 7. 19	160, 427. 37	176, 741. 46
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		3, 078, 677. 37	17, 824, 222. 69
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		3, 078, 677. 37	17, 824, 222. 69

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 人保中证500指数型证券投资基金

本报告期: 2021年01月01日至2021年06月30日

单位: 人民币元

项 目	本期		
	2021年01月01日至2021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	29, 742, 545. 77	15, 278, 522. 32	45, 021, 068. 09

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,078,677.37	3,078,677.37
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)	-4,853,142.27	-2,728,871.57	-7,582,013.84
其中: 1. 基金申购款	8,709,741.77	4,701,716.66	13,411,458.43
2. 基金赎回款	-13,562,884.04	-7,430,588.23	-20,993,472.27
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)	24,889,403.50	15,628,328.12	40,517,731.62
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	148,511,296.02	31,405,646.04	179,916,942.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,824,222.69	17,824,222.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-64,654,014.10	-17,551,780.48	-82,205,794.58
其中: 1. 基金申购款	37,767,689.68	10,200,963.58	47,968,653.26
2. 基金赎回款	-102,421,703.78	-27,752,744.06	-130,174,447.84

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	83,857,281.92	31,678,088.25	115,535,370.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

曾北川

韩松

沈静

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于其他股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(包括分离交易可转债))、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款及其他银行存款等)、货币市场工具、金融衍生工具(包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股

及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权需缴纳的现金保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准：中证500指数收益率×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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税财税[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。

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 2021年06月30日
活期存款	942,090.11
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	942,090.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	33,373,276.32	38,118,067.34	4,744,791.02	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,786,685.00	1,784,000.00	-2,685.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,786,685.00	1,784,000.00	-2,685.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	35,159,961.32	39,902,067.34	4,742,106.02	

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 2021年06月30日
应收活期存款利息	193.49
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	-
应收债券利息	36,779.73
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	6.60
合计	36,979.82

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	16,000.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	16,000.33

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	524.40
预提费用	59,507.37
其他应付	50,000.00
合计	110,031.77

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	29,742,545.77	29,742,545.77
本期申购	8,709,741.77	8,709,741.77
本期赎回（以“-”号填列）	-13,562,884.04	-13,562,884.04
本期末	24,889,403.50	24,889,403.50

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。

6.4.7.9 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	23,822,256.73	-8,543,734.41	15,278,522.32
本期利润	4,315,689.32	-1,237,011.95	3,078,677.37
本期基金份额交易产生的变动数	-3,948,053.22	1,219,181.65	-2,728,871.57
其中：基金申购款	7,270,825.86	-2,569,109.20	4,701,716.66
基金赎回款	-11,218,879.08	3,788,290.85	-7,430,588.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,189,892.83	-8,561,564.71	15,628,328.12

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	3,266.41
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	103.94
其他	156.80
合计	3,527.15

6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	18,465,671.39
减：卖出股票成本总额	14,204,228.79
买卖股票差价收入	4,261,442.60

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021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	-4,102.22
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	-4,102.22

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,177,925.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,134,102.22
减：应收利息总额	47,925.00
买卖债券差价收入	-4,102.22

6.4.7.12.3 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	333,010.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	333,010.51

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,237,011.95
——股票投资	-1,238,642.17
——债券投资	1,630.22
——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	-1,237,011.95

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	15,588.67
转换费收入	0.05
合计	15,588.72

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	42,556.50
银行间市场交易费用	-
合计	42,556.50

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
汇划手续费	920.00
其他费用_指数使用费	100,000.00
合计	160,427.37

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

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	89,675.50	324,548.65
其中：支付销售机构的客户维护费	27,819.43	36,775.79

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 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	19,927.84	72,121.93

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

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	7,199,000.00	7,199,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	7,199,000.00	7,199,000.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.92%	8.58%
---------------------	--------	-------

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	942,090.11	3,266.41	1,599,501.59	13,029.08

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

6.4.10.6 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。

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。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
6052	德才	2021	2021	新股	31.5	31.5	262	8,26	8,26	-

87	股份	-06-28	-07-06	锁定	6	6		8.72	8.72	
----	----	--------	--------	----	---	---	--	------	------	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	-	56.35	2021-07-01	59.49	5,000	78,126.64	281,750.00	-
600811	东方集团	2021-06-30	-	3.05	2021-07-14	3.36	19,100	71,258.13	58,255.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.13 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

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6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	942,090.11	-	-	-	942,090.11
存出保证金	14,661.41	-	-	-	14,661.41
交易性金融资产	1,784,000.00	-	-	38,118,067.34	39,902,067.34
应收证券清算款	-	-	-	13,834.18	13,834.18
应收利息	-	-	-	36,979.82	36,979.82
应收申购款	-	-	-	91,352.68	91,352.68
资产总计	2,740,751.52	-	-	38,260,234.02	41,000,985.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	339,083.49	339,083.49
应付管理人报酬	-	-	-	14,840.48	14,840.48
应付托管费	-	-	-	3,297.85	3,297.85
应付交易费用	-	-	-	16,000.33	16,000.33
其他负债	-	-	-	110,031.77	110,031.77
负债总计	-	-	-	483,253.92	483,253.92
利率敏感度缺	2,740,751.52	-	-	37,776,980.10	40,517,731.62

口					
上年度末 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

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 市场利率上升25个基点	-190.64	-130.12
	2. 市场利率下降25个基点	191.12	130.45

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

于6月30日,本基金面临的其他市场价格风险列示如下:

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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	38,118,067.34	94.08	42,152,221.48	93.63
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	38,118,067.34	94.08	42,152,221.48	93.63

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险		
	Beta系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准增加5%	1,518,199.40	2,074,295.08
	2. 业绩比较基准减少5%	-1,518,199.40	-2,074,295.08

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021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39,893,798.62元，第二层次的余额为人民币

8,268.72元,无第三层次的余额(于2020年12月31日,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)。

(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。

§ 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	38,118,067.34	92.97
	其中:股票	38,118,067.34	92.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,784,000.00	4.35
	其中:债券	1,784,000.00	4.35
	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	942,090.11	2.30
8	其他各项资产	156,828.09	0.38
9	合计	41,000,985.54	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	352,848.00	0.87
B	采矿业	1,350,963.39	3.33
C	制造业	23,931,128.15	59.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	930,811.62	2.30
E	建筑业	757,068.26	1.87
F	批发和零售业	1,315,334.13	3.25
G	交通运输、仓储和邮政业	759,559.92	1.87
H	住宿和餐饮业	205,428.20	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,125,533.32	7.71
J	金融业	2,227,908.04	5.50
K	房地产业	1,238,632.06	3.06
L	租赁和商务服务业	501,409.40	1.24
M	科学研究和技术服务业	96,901.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	333,861.07	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,808.57	0.05
Q	卫生和社会工作	107,240.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	389,467.91	0.96
S	综合	345,373.40	0.85
	合计	37,989,276.44	93.76

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,306.92	0.02
D	电力、热力、燃气及水生	2,894.88	0.01

	产和供应业		
E	建筑业	8,268.72	0.02
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	7,084.80	0.02
J	金融业	101,235.58	0.25
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	128,790.90	0.32

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	000799	酒鬼酒	1,500	383,400.00	0.95

2	002709	天赐材料	3,580	381,556.40	0.94
3	603486	科沃斯	1,493	340,523.44	0.84
4	600089	特变电工	23,800	305,830.00	0.75
5	000009	中国宝安	16,520	301,820.40	0.74
6	002074	国轩高科	6,600	287,496.00	0.71
7	600460	士兰微	5,000	281,750.00	0.70
8	601233	桐昆股份	10,300	248,127.00	0.61
9	300285	国瓷材料	4,900	238,875.00	0.59
10	300207	欣旺达	7,100	231,176.00	0.57
11	002340	格林美	24,500	229,075.00	0.57
12	002185	华天科技	14,100	216,999.00	0.54
13	300316	晶盛机电	4,100	207,050.00	0.51
14	600885	宏发股份	3,300	206,910.00	0.51
15	601636	旗滨集团	10,300	191,168.00	0.47
16	600733	北汽蓝谷	13,700	184,676.00	0.46
17	300146	汤臣倍健	5,500	180,950.00	0.45
18	300253	卫宁健康	10,900	177,343.00	0.44
19	002648	卫星石化	4,360	170,868.40	0.42
20	600884	杉杉股份	7,230	168,603.60	0.42
21	600219	南山铝业	46,000	165,600.00	0.41
22	002353	杰瑞股份	3,700	165,390.00	0.41
23	600779	水井坊	1,300	164,255.00	0.41
24	600739	辽宁成大	7,800	162,318.00	0.40
25	603737	三棵树	920	161,920.00	0.40
26	300037	新宙邦	1,600	160,160.00	0.40
27	603444	吉比特	300	159,000.00	0.39
28	002138	顺络电子	4,100	158,957.00	0.39
29	000547	航天发展	8,281	156,262.47	0.39
30	600392	盛和资源	9,000	156,240.00	0.39
31	603589	口子窖	2,300	155,687.00	0.38
32	002444	巨星科技	4,400	149,952.00	0.37

33	601099	太平洋	43,700	148,143.00	0.37
34	002223	鱼跃医疗	3,850	146,800.50	0.36
35	688099	晶晨股份	1,300	145,860.00	0.36
36	601168	西部矿业	12,200	145,546.00	0.36
37	002625	光启技术	6,900	143,589.00	0.35
38	688002	睿创微纳	1,400	139,762.00	0.34
39	002439	启明星辰	4,800	139,248.00	0.34
40	000636	风华高科	4,600	139,012.00	0.34
41	600862	中航高科	4,500	138,510.00	0.34
42	601117	中国化学	15,800	138,408.00	0.34
43	000830	鲁西化工	7,300	136,729.00	0.34
44	002797	第一创业	18,900	134,946.00	0.33
45	600486	扬农化工	1,200	134,124.00	0.33
46	600699	均胜电子	5,240	133,724.80	0.33
47	002078	太阳纸业	10,000	133,500.00	0.33
48	002030	达安基因	6,273	133,238.52	0.33
49	600068	葛洲坝	17,700	132,573.00	0.33
50	600315	上海家化	2,200	132,308.00	0.33
51	002180	纳思达	4,100	132,020.00	0.33
52	002250	联化科技	4,700	131,130.00	0.32
53	600754	锦江酒店	2,300	130,985.00	0.32
54	300088	长信科技	15,700	129,682.00	0.32
55	002422	科伦药业	6,500	129,675.00	0.32
56	300699	光威复材	1,700	129,115.00	0.32
57	000630	铜陵有色	47,200	128,384.00	0.32
58	300357	我武生物	2,000	128,240.00	0.32
59	002507	涪陵榨菜	3,400	128,044.00	0.32
60	002385	大北农	18,800	127,840.00	0.32
61	600563	法拉电子	807	127,796.52	0.32
62	600704	物产中大	16,200	127,494.00	0.31
63	601997	贵阳银行	17,800	127,448.00	0.31

64	600201	生物股份	7,200	125,640.00	0.31
65	002013	中航机电	12,449	125,361.43	0.31
66	000039	中集集团	6,880	125,078.40	0.31
67	002075	沙钢股份	11,300	123,283.00	0.30
68	300308	中际旭创	3,200	123,264.00	0.30
69	000988	华工科技	5,200	122,304.00	0.30
70	300223	北京君正	1,200	121,104.00	0.30
71	002028	思源电气	3,900	120,081.00	0.30
72	000513	丽珠集团	2,400	120,048.00	0.30
73	000807	云铝股份	10,019	119,226.10	0.29
74	002212	天融信	5,964	117,908.28	0.29
75	600177	雅戈尔	17,800	117,302.00	0.29
76	002511	中顺洁柔	4,200	115,710.00	0.29
77	000021	深科技	6,000	114,840.00	0.28
78	002273	水晶光电	7,798	114,552.62	0.28
79	300001	特锐德	3,800	114,418.00	0.28
80	002603	以岭药业	3,900	113,724.00	0.28
81	002092	中泰化学	11,000	112,970.00	0.28
82	002080	中材科技	4,300	112,531.00	0.28
83	600549	厦门钨业	5,400	112,482.00	0.28
84	000739	普洛药业	3,800	111,720.00	0.28
85	002465	海格通信	11,800	111,628.00	0.28
86	300009	安科生物	7,356	109,604.40	0.27
87	600171	上海贝岭	3,600	109,548.00	0.27
88	000983	山西焦煤	13,170	109,442.70	0.27
89	000825	太钢不锈	14,600	109,354.00	0.27
90	300482	万孚生物	1,680	108,679.20	0.27
91	600867	通化东宝	9,100	108,654.00	0.27
92	600516	方大炭素	14,600	108,624.00	0.27
93	600536	中国软件	1,900	108,167.00	0.27
94	600316	洪都航空	2,800	107,744.00	0.27

95	002127	南极电商	11,000	107,470.00	0.27
96	600637	东方明珠	13,100	107,289.00	0.26
97	300244	迪安诊断	2,800	107,240.00	0.26
98	601127	小康股份	1,600	106,672.00	0.26
99	600066	宇通客车	8,500	106,165.00	0.26
100	600418	江淮汽车	8,500	105,655.00	0.26
101	600529	山东药玻	3,100	105,245.00	0.26
102	300463	迈克生物	2,500	105,225.00	0.26
103	600879	航天电子	13,900	104,528.00	0.26
104	300070	碧水源	14,200	103,802.00	0.26
105	600487	亨通光电	9,100	103,740.00	0.26
106	600369	西南证券	21,300	103,731.00	0.26
107	000750	国海证券	24,400	103,456.00	0.26
108	002156	通富微电	4,300	103,372.00	0.26
109	600827	百联股份	5,115	103,067.25	0.25
110	600380	健康元	7,500	102,975.00	0.25
111	000960	锡业股份	6,400	102,592.00	0.25
112	600166	福田汽车	29,500	101,775.00	0.25
113	000975	银泰黄金	10,660	101,376.60	0.25
114	600909	华安证券	18,120	100,928.40	0.25
115	601689	拓普集团	2,685	100,499.55	0.25
116	601005	重庆钢铁	37,600	100,392.00	0.25
117	002131	利欧股份	42,900	100,386.00	0.25
118	002152	广电运通	7,700	100,331.00	0.25
119	600038	中直股份	1,900	100,206.00	0.25
120	002572	索菲亚	4,125	99,825.00	0.25
121	300383	光环新网	6,900	99,291.00	0.25
122	000723	美锦能源	13,100	99,036.00	0.24
123	300474	景嘉微	1,000	97,920.00	0.24
124	601198	东兴证券	8,800	96,184.00	0.24
125	603290	斯达半导	300	96,000.00	0.24

126	600988	赤峰黄金	6,400	95,936.00	0.24
127	600642	申能股份	15,623	95,925.22	0.24
128	002299	圣农发展	4,000	95,520.00	0.24
129	601866	中远海发	25,400	95,250.00	0.24
130	002065	东华软件	12,000	95,160.00	0.23
131	002690	美亚光电	1,701	94,847.76	0.23
132	300115	长盈精密	4,600	94,760.00	0.23
133	000998	隆平高科	5,900	94,636.00	0.23
134	002683	宏大爆破	3,400	94,418.00	0.23
135	688029	南微医学	300	93,507.00	0.23
136	002500	山西证券	13,800	92,598.00	0.23
137	600271	航天信息	7,100	92,513.00	0.23
138	000623	吉林敖东	5,918	91,669.82	0.23
139	603156	养元饮品	3,200	91,456.00	0.23
140	600895	张江高科	5,000	91,350.00	0.23
141	601699	潞安环能	7,700	90,937.00	0.22
142	000012	南玻 A	8,848	90,603.52	0.22
143	600415	小商品城	17,400	89,610.00	0.22
144	000050	深天马 A	6,300	89,334.00	0.22
145	300296	利亚德	11,400	89,148.00	0.22
146	600153	建发股份	11,000	89,100.00	0.22
147	002294	信立泰	2,700	88,830.00	0.22
148	002831	裕同科技	2,989	88,743.41	0.22
149	002966	苏州银行	12,000	88,200.00	0.22
150	600188	兖州煤业	5,700	87,552.00	0.22
151	002958	青农商行	20,300	86,884.00	0.21
152	300418	昆仑万维	5,300	86,814.00	0.21
153	600256	广汇能源	26,000	86,580.00	0.21
154	300630	普利制药	1,650	86,460.00	0.21
155	600667	太极实业	9,500	86,450.00	0.21
156	600390	五矿资本	14,400	86,112.00	0.21

157	600535	天士力	5,800	85,898.00	0.21
158	300024	机器人	8,000	85,360.00	0.21
159	600008	首创环保	28,200	84,882.00	0.21
160	600060	海信视像	5,000	84,500.00	0.21
161	002670	国盛金控	7,400	84,286.00	0.21
162	002557	洽洽食品	1,952	84,131.20	0.21
163	600155	华创阳安	7,847	83,962.90	0.21
164	600208	新湖中宝	27,600	83,904.00	0.21
165	600498	烽火通信	4,500	83,835.00	0.21
166	000027	深圳能源	9,120	83,630.40	0.21
167	000878	云南铜业	6,509	83,510.47	0.21
168	002373	千方科技	5,000	83,500.00	0.21
169	002382	蓝帆医疗	4,000	83,400.00	0.21
170	603858	步长制药	3,700	83,213.00	0.21
171	002372	伟星新材	4,000	82,680.00	0.20
172	002081	金螳螂	10,300	81,576.00	0.20
173	600765	中航重机	3,600	81,540.00	0.20
174	600372	中航电子	4,900	81,095.00	0.20
175	300251	光线传媒	7,500	81,075.00	0.20
175	002019	亿帆医药	4,700	81,075.00	0.20
177	002221	东华能源	7,400	81,030.00	0.20
178	002926	华西证券	8,400	80,892.00	0.20
179	002174	游族网络	4,700	80,699.00	0.20
180	000718	苏宁环球	9,700	80,413.00	0.20
181	300271	华宇软件	4,170	80,272.50	0.20
182	600409	三友化工	7,900	79,869.00	0.20
183	601577	长沙银行	8,900	79,566.00	0.20
184	600511	国药股份	2,400	79,344.00	0.20
185	300618	寒锐钴业	1,000	78,840.00	0.19
186	000997	新大陆	4,750	78,802.50	0.19
187	603605	珀莱雅	400	78,684.00	0.19

188	600170	上海建工	28,500	78,660.00	0.19
189	002390	信邦制药	7,500	78,600.00	0.19
190	002506	协鑫集成	22,500	78,300.00	0.19
191	601717	郑煤机	6,700	77,921.00	0.19
192	600875	东方电气	7,100	77,887.00	0.19
193	000932	华菱钢铁	11,780	77,748.00	0.19
194	601615	明阳智能	4,800	77,712.00	0.19
195	603866	桃李面包	2,484	77,500.80	0.19
196	300058	蓝色光标	12,800	77,440.00	0.19
197	300168	万达信息	5,300	77,380.00	0.19
198	600801	华新水泥	4,400	77,308.00	0.19
199	000738	航发控制	3,700	77,071.00	0.19
200	600039	四川路桥	12,200	76,494.00	0.19
201	000686	东北证券	9,050	76,472.50	0.19
202	600160	巨化股份	8,641	76,386.44	0.19
203	002408	齐翔腾达	6,100	75,762.00	0.19
204	300315	掌趣科技	17,700	75,225.00	0.19
205	603707	健友股份	1,800	75,150.00	0.19
206	002195	二三四五	36,750	74,602.50	0.18
207	600663	陆家嘴	5,600	74,592.00	0.18
208	600258	首旅酒店	3,120	74,443.20	0.18
209	000401	冀东水泥	6,000	74,100.00	0.18
210	002268	卫士通	3,800	74,024.00	0.18
211	600998	九州通	4,800	73,776.00	0.18
212	300017	网宿科技	12,600	73,710.00	0.18
213	600325	华发股份	10,900	73,466.00	0.18
214	000540	中天金融	26,900	73,437.00	0.18
215	688088	虹软科技	1,300	72,475.00	0.18
216	000060	中金岭南	16,000	72,320.00	0.18
217	600859	王府井	2,500	72,200.00	0.18
218	600027	华电国际	20,900	71,896.00	0.18

219	601992	金隅集团	26,700	71,823.00	0.18
220	000961	中南建设	12,100	71,632.00	0.18
221	600567	山鹰国际	20,600	71,070.00	0.18
222	603077	和邦生物	34,000	70,720.00	0.17
223	603883	老百姓	1,340	70,591.20	0.17
224	002429	兆驰股份	11,600	70,412.00	0.17
225	600497	驰宏锌锗	16,300	70,253.00	0.17
226	600282	南钢股份	19,700	70,132.00	0.17
227	000158	常山北明	6,100	70,089.00	0.17
228	600500	中化国际	8,900	69,954.00	0.17
229	603638	艾迪精密	1,620	69,449.40	0.17
230	002595	豪迈科技	2,600	69,420.00	0.17
231	603260	合盛硅业	900	69,219.00	0.17
232	600737	中粮糖业	6,900	69,069.00	0.17
233	600755	厦门国贸	8,400	68,964.00	0.17
234	002056	横店东磁	5,300	68,900.00	0.17
235	600528	中铁工业	8,500	68,850.00	0.17
236	600216	浙江医药	4,300	68,843.00	0.17
237	600598	北大荒	4,600	68,816.00	0.17
238	600839	四川长虹	23,629	68,760.39	0.17
239	603927	中科软	1,600	68,720.00	0.17
240	000898	鞍钢股份	15,400	68,530.00	0.17
241	600141	兴发集团	3,600	67,788.00	0.17
242	300212	易华录	2,500	67,275.00	0.17
243	002203	海亮股份	6,307	67,106.48	0.17
244	000709	河钢股份	27,200	66,912.00	0.17
245	000999	华润三九	2,500	66,875.00	0.17
246	600728	佳都科技	9,000	66,690.00	0.16
247	000581	威孚高科	3,200	66,656.00	0.16
248	600580	卧龙电驱	5,000	66,500.00	0.16
249	603198	迎驾贡酒	1,500	66,450.00	0.16

250	002281	光迅科技	2,700	66,420.00	0.16
251	300182	捷成股份	13,205	65,892.95	0.16
252	600808	马钢股份	15,300	65,637.00	0.16
253	600908	无锡银行	11,300	65,540.00	0.16
254	000729	燕京啤酒	9,000	65,160.00	0.16
255	000930	中粮科技	7,200	64,872.00	0.16
256	002010	传化智联	8,400	64,764.00	0.16
257	002745	木林森	4,800	64,320.00	0.16
258	000488	晨鸣纸业	7,900	64,306.00	0.16
259	002242	九阳股份	1,979	64,297.71	0.16
260	300166	东方国信	5,200	64,272.00	0.16
261	002396	星网锐捷	3,000	64,050.00	0.16
262	600820	隧道股份	12,100	64,009.00	0.16
263	002004	华邦健康	10,200	63,342.00	0.16
264	002146	荣盛发展	11,200	63,168.00	0.16
265	000629	攀钢钒钛	27,500	62,975.00	0.16
266	002563	森马服饰	5,200	62,140.00	0.15
267	600970	中材国际	6,700	61,439.00	0.15
268	300002	神州泰岳	12,600	61,110.00	0.15
269	002048	宁波华翔	3,097	60,391.50	0.15
270	600022	山东钢铁	35,060	60,303.20	0.15
271	603000	人民网	3,500	60,165.00	0.15
272	600398	海澜之家	8,300	60,092.00	0.15
273	688321	微芯生物	1,300	60,047.00	0.15
274	000598	兴蓉环境	11,500	59,915.00	0.15
275	600037	歌华有线	6,210	59,678.10	0.15
276	601106	中国一重	17,600	59,664.00	0.15
277	600803	新奥股份	3,600	59,436.00	0.15
278	600881	亚泰集团	20,787	59,242.95	0.15
279	601975	招商南油	27,500	58,850.00	0.15
280	002191	劲嘉股份	5,500	58,520.00	0.14

281	002925	盈趣科技	1,500	58,365.00	0.14
282	600811	东方集团	19,100	58,255.00	0.14
283	603885	吉祥航空	3,800	57,988.00	0.14
284	002124	天邦股份	8,220	57,622.20	0.14
285	601880	辽港股份	33,600	57,456.00	0.14
286	000883	湖北能源	12,500	57,375.00	0.14
287	000778	新兴铸管	15,400	57,288.00	0.14
288	000690	宝新能源	11,200	57,232.00	0.14
289	600348	华阳股份	7,700	57,134.00	0.14
290	601456	国联证券	3,700	56,980.00	0.14
291	600782	新钢股份	10,200	56,916.00	0.14
292	600260	凯乐科技	6,400	56,832.00	0.14
293	000887	中鼎股份	4,670	56,413.60	0.14
294	002867	周大生	2,850	56,344.50	0.14
295	600597	光明乳业	3,900	56,199.00	0.14
296	601118	海南橡胶	11,000	55,990.00	0.14
297	002701	奥瑞金	10,800	55,512.00	0.14
298	603568	伟明环保	2,420	55,248.60	0.14
299	002705	新宝股份	2,100	55,125.00	0.14
300	000671	阳光城	10,600	55,120.00	0.14
301	002839	张家港行	10,100	54,944.00	0.14
302	002085	万丰奥威	9,800	54,880.00	0.14
303	600026	中远海能	8,900	54,824.00	0.14
304	600718	东软集团	5,600	54,768.00	0.14
305	002183	怡亚通	9,540	54,664.20	0.13
306	600967	内蒙一机	5,400	54,648.00	0.13
307	600410	华胜天成	7,024	54,506.24	0.13
308	002387	维信诺	5,212	54,361.16	0.13
309	600732	爱旭股份	3,900	54,288.00	0.13
310	603712	七一二	1,500	54,150.00	0.13
311	000528	柳工	6,600	54,120.00	0.13

312	601179	中国西电	13,100	53,972.00	0.13
313	600572	康恩贝	12,000	53,280.00	0.13
314	002110	三钢闽光	7,900	53,246.00	0.13
315	600435	北方导航	6,702	53,213.88	0.13
316	600985	淮北矿业	4,349	53,101.29	0.13
317	601860	紫金银行	14,600	52,998.00	0.13
318	603650	彤程新材	1,100	52,910.00	0.13
319	600167	联美控股	5,900	52,687.00	0.13
320	002368	太极股份	2,620	52,557.20	0.13
321	000970	中科三环	5,500	52,525.00	0.13
322	002936	郑州银行	14,220	52,187.40	0.13
323	000877	天山股份	4,000	52,120.00	0.13
324	601200	上海环境	4,351	52,081.47	0.13
325	000402	金融街	7,709	52,035.75	0.13
326	600446	金证股份	3,600	51,984.00	0.13
327	300072	三聚环保	9,004	51,682.96	0.13
328	002266	浙富控股	10,300	51,397.00	0.13
329	000089	深圳机场	6,600	51,282.00	0.13
330	600064	南京高科	5,500	51,095.00	0.13
331	601598	中国外运	10,100	51,005.00	0.13
332	000990	诚志股份	4,000	50,920.00	0.13
333	002128	露天煤业	4,880	50,800.80	0.13
334	600329	中新药业	1,800	50,562.00	0.12
335	002002	鸿达兴业	12,800	50,304.00	0.12
336	600928	西安银行	10,700	49,862.00	0.12
337	002985	北摩高科	510	49,725.00	0.12
338	000400	许继电气	3,900	49,374.00	0.12
339	300026	红日药业	11,550	49,087.50	0.12
340	600158	中体产业	4,300	49,063.00	0.12
341	003035	南网能源	4,900	48,706.00	0.12
342	000519	中兵红箭	4,500	48,240.00	0.12

343	600645	中源协和	2,100	48,195.00	0.12
344	601016	节能风电	12,800	47,872.00	0.12
345	002249	大洋电机	9,100	47,775.00	0.12
346	600120	浙江东方	11,128	47,627.84	0.12
347	300376	易事特	5,900	47,436.00	0.12
348	002233	塔牌集团	4,600	47,288.00	0.12
349	000959	首钢股份	8,400	47,208.00	0.12
350	600195	中牧股份	3,944	47,170.24	0.12
351	600507	方大特钢	6,898	46,768.44	0.12
352	600307	酒钢宏兴	20,100	46,632.00	0.12
353	000685	中山公用	5,700	46,512.00	0.11
354	600376	首开股份	8,300	46,480.00	0.11
355	001914	招商积余	2,700	46,386.00	0.11
356	600021	上海电力	6,700	46,297.00	0.11
357	000090	天健集团	8,342	46,131.26	0.11
358	601333	广深铁路	21,700	46,004.00	0.11
359	601000	唐山港	19,000	45,790.00	0.11
360	000559	万向钱潮	8,483	45,044.73	0.11
361	600126	杭钢股份	8,700	44,631.00	0.11
362	600804	鹏博士	9,200	44,528.00	0.11
363	600673	东阳光	9,700	43,553.00	0.11
364	600373	中文传媒	4,394	43,324.84	0.11
365	600707	彩虹股份	4,600	43,286.00	0.11
366	603228	景旺电子	1,647	43,151.40	0.11
367	300133	华策影视	7,280	43,097.60	0.11
368	002038	双鹭药业	4,000	42,120.00	0.10
369	601991	大唐发电	15,900	41,976.00	0.10
370	000967	盈峰环境	6,100	41,907.00	0.10
371	002244	滨江集团	10,000	41,900.00	0.10
372	603893	瑞芯微	300	41,838.00	0.10
373	000758	中色股份	8,800	41,800.00	0.10

374	601608	中信重工	11,083	41,450.42	0.10
375	002155	湖南黄金	5,348	41,447.00	0.10
376	600582	天地科技	10,600	41,340.00	0.10
377	600056	中国医药	3,400	41,310.00	0.10
378	600266	城建发展	8,672	41,105.28	0.10
379	600388	龙净环保	4,800	40,896.00	0.10
380	000563	陕国投 A	12,700	40,894.00	0.10
381	300741	华宝股份	800	40,576.00	0.10
382	600259	广晟有色	1,200	40,572.00	0.10
383	601098	中南传媒	4,590	40,483.80	0.10
384	601958	金钼股份	6,200	40,176.00	0.10
385	600901	江苏租赁	7,700	40,040.00	0.10
386	600062	华润双鹤	3,360	40,017.60	0.10
387	002416	爱施德	3,980	39,919.40	0.10
388	003022	联泓新科	1,300	39,910.00	0.10
389	601718	际华集团	14,100	39,762.00	0.10
390	300180	华峰超纤	7,900	39,105.00	0.10
391	600959	江苏有线	12,800	39,040.00	0.10
392	002440	闰土股份	4,400	38,940.00	0.10
393	600094	大名城	10,244	38,619.88	0.10
394	600649	城投控股	8,100	38,556.00	0.10
395	000415	渤海租赁	15,900	38,478.00	0.09
396	600776	东方通信	3,100	38,440.00	0.09
397	002458	益生股份	3,800	37,886.00	0.09
398	000028	国药一致	1,001	37,877.84	0.09
399	002399	海普瑞	2,371	37,770.03	0.09
400	300257	开山股份	2,600	37,362.00	0.09
401	002948	青岛银行	7,500	37,275.00	0.09
402	600006	东风汽车	5,100	37,230.00	0.09
403	603225	新凤鸣	1,820	36,946.00	0.09
404	601611	中国核建	5,100	36,822.00	0.09

405	600546	山煤国际	5,100	36,618.00	0.09
406	002505	鹏都农牧	16,300	36,512.00	0.09
407	600643	爱建集团	5,200	36,296.00	0.09
408	600717	天津港	9,226	36,165.92	0.09
409	002317	众生药业	4,200	36,162.00	0.09
410	600633	浙数文化	5,000	35,900.00	0.09
411	000717	韶钢松山	7,800	35,802.00	0.09
412	600729	重庆百货	1,302	35,739.90	0.09
413	600648	外高桥	2,400	35,472.00	0.09
414	000501	鄂武商 A	3,007	35,181.90	0.09
415	601928	凤凰传媒	4,900	34,986.00	0.09
416	300113	顺网科技	2,700	34,938.00	0.09
417	000681	视觉中国	2,700	34,911.00	0.09
418	002434	万里扬	4,300	34,873.00	0.09
419	600863	内蒙华电	14,900	34,717.00	0.09
420	605358	立昂微	300	34,674.00	0.09
421	000078	海王生物	10,600	34,556.00	0.09
422	600835	上海机电	2,100	34,125.00	0.08
423	002375	亚厦股份	4,300	34,056.00	0.08
424	000062	深圳华强	2,000	33,820.00	0.08
425	600968	海油发展	13,000	33,670.00	0.08
426	601828	美凯龙	2,800	33,600.00	0.08
427	000869	张裕 A	900	33,426.00	0.08
428	002424	贵州百灵	4,500	33,120.00	0.08
429	600623	华谊集团	3,585	31,583.85	0.08
430	600377	宁沪高速	3,200	31,232.00	0.08
431	603355	莱克电气	500	31,115.00	0.08
432	600131	国网信通	2,300	30,452.00	0.08
433	600566	济川药业	1,700	30,430.00	0.08
434	600339	中油工程	10,700	30,388.00	0.07
435	600312	平高电气	5,200	30,368.00	0.07

436	600639	浦东金桥	2,215	30,234.75	0.07
437	600787	中储股份	5,600	29,848.00	0.07
438	000031	大悦城	8,267	29,761.20	0.07
439	002583	海能达	5,900	29,736.00	0.07
440	002468	申通快递	3,900	29,718.00	0.07
441	000826	启迪环境	5,500	29,425.00	0.07
442	600823	世茂股份	7,200	29,088.00	0.07
443	601969	海南矿业	2,500	29,075.00	0.07
444	601778	晶科科技	5,300	28,938.00	0.07
445	002815	崇达技术	2,300	28,704.00	0.07
446	600466	蓝光发展	9,700	28,615.00	0.07
447	601187	厦门银行	3,000	28,440.00	0.07
448	600095	湘财股份	2,400	28,104.00	0.07
449	601298	青岛港	4,500	27,810.00	0.07
450	603708	家家悦	1,600	27,792.00	0.07
451	000156	华数传媒	3,600	27,756.00	0.07
452	002532	天山铝业	3,300	27,687.00	0.07
453	603888	新华网	1,300	27,521.00	0.07
454	603317	天味食品	928	27,311.04	0.07
455	600517	国网英大	4,000	27,240.00	0.07
456	000937	冀中能源	6,800	26,724.00	0.07
457	002635	安洁科技	1,800	26,334.00	0.06
458	688208	道通科技	300	26,097.00	0.06
459	000553	安道麦A	2,800	25,956.00	0.06
460	000813	德展健康	5,700	25,878.00	0.06
461	603515	欧普照明	1,000	25,670.00	0.06
462	300010	豆神教育	4,500	25,515.00	0.06
463	600764	中国海防	900	25,470.00	0.06
464	002302	西部建设	3,200	25,280.00	0.06
465	601228	广州港	7,900	25,122.00	0.06
466	600350	山东高速	4,000	24,600.00	0.06

467	600640	号百控股	2,000	24,380.00	0.06
468	600556	天下秀	2,300	24,288.00	0.06
468	000061	农产品	4,400	24,288.00	0.06
470	601139	深圳燃气	3,700	24,272.00	0.06
471	600871	石化油服	12,200	24,034.00	0.06
472	603056	德邦股份	2,100	23,079.00	0.06
473	000046	泛海控股	10,000	23,000.00	0.06
474	603379	三美股份	1,220	22,826.20	0.06
475	603786	科博达	300	22,650.00	0.06
476	002901	大博医疗	300	21,867.00	0.05
477	002653	海思科	1,000	21,520.00	0.05
478	601568	北元集团	2,500	21,400.00	0.05
479	002419	天虹股份	3,119	20,460.64	0.05
480	603377	东方时尚	1,853	19,808.57	0.05
481	601869	长飞光纤	800	19,488.00	0.05
482	601003	柳钢股份	3,300	19,470.00	0.05
483	600657	信达地产	5,500	19,140.00	0.05
484	000537	广宇发展	3,540	18,514.20	0.05
485	601801	皖新传媒	3,801	17,940.72	0.04
486	002946	新乳业	1,100	16,665.00	0.04
487	603983	丸美股份	300	15,633.00	0.04
488	600903	贵州燃气	1,660	15,272.00	0.04
489	001872	招商港口	800	13,536.00	0.03
490	603719	良品铺子	300	13,500.00	0.03
491	002423	中粮资本	1,400	12,670.00	0.03
492	603868	飞科电器	300	12,618.00	0.03
493	600917	重庆燃气	1,400	11,438.00	0.03
494	002818	富森美	920	11,095.20	0.03
495	601512	中新集团	1,100	10,956.00	0.03
496	600956	新天绿能	900	10,539.00	0.03
497	603256	宏和科技	1,100	10,054.00	0.02

498	601068	中铝国际	2,000	6,900.00	0.02
-----	--------	------	-------	----------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600906	财达证券	4,730	79,842.40	0.20
2	601528	瑞丰银行	1,374	21,393.18	0.05
3	001208	华菱线缆	1,204	9,306.92	0.02
4	605287	德才股份	262	8,268.72	0.02
5	603171	N税友	369	7,084.80	0.02
6	605011	N杭热	326	2,894.88	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000799	酒鬼酒	361,761.00	0.80
2	300207	欣旺达	206,101.00	0.46
3	002340	格林美	205,088.00	0.46
4	300146	汤臣倍健	188,644.00	0.42
5	601636	旗滨集团	181,898.00	0.40
6	600733	北汽蓝谷	177,489.00	0.39
7	300253	卫宁健康	175,272.00	0.39
8	601233	桐昆股份	166,751.00	0.37
9	300037	新宙邦	151,200.00	0.34
10	002439	启明星辰	146,688.00	0.33
11	600089	特变电工	137,667.00	0.31
12	600177	雅戈尔	132,966.00	0.30
13	002422	科伦药业	131,950.00	0.29

14	000547	航天发展	125,256.00	0.28
15	300308	中际旭创	123,936.00	0.28
16	600536	中国软件	123,082.00	0.27
17	600068	葛洲坝	122,838.00	0.27
18	002092	中泰化学	119,240.00	0.26
19	600637	东方明珠	113,184.00	0.25
20	600066	宇通客车	112,051.00	0.25

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	773,769.00	1.72
2	300012	华测检测	429,650.00	0.95
3	600426	华鲁恒升	387,636.84	0.86
4	300595	欧普康视	340,763.60	0.76
5	300496	中科创达	316,273.92	0.70
6	600132	重庆啤酒	307,907.00	0.68
7	603882	金域医学	305,760.00	0.68
8	600143	金发科技	269,210.98	0.60
9	603806	福斯特	249,426.00	0.55
10	601966	玲珑轮胎	231,121.72	0.51
11	002340	格林美	230,489.00	0.51
12	002568	百润股份	222,432.00	0.49
13	600079	人福医药	217,080.00	0.48
14	601233	桐昆股份	213,578.00	0.47
15	601799	星宇股份	211,610.00	0.47
16	603345	安井食品	202,405.00	0.45
17	300207	欣旺达	190,712.00	0.42
18	600089	特变电工	184,870.00	0.41

19	603816	顾家家居	182,461.00	0.41
20	002791	坚朗五金	179,921.00	0.40

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	11,408,716.82
卖出股票收入（成交）总额	18,465,671.39

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	1,784,000.00	4.40
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	1,784,000.00	4.40

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	019640	20国债10	17,840	1,784,000.00	4.40
---	--------	--------	--------	--------------	------

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投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 酒鬼酒（代码：000799）为本基金前十大持仓证券。2021年1月4日酒鬼酒收到深圳交易所监管函。因公司通过非法定信息披露渠道自行对外发布涉及公司经营的重要信息，违反了交易所相关规定，收到交易所监管函。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，江苏监管局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。本基金投资酒鬼酒、国轩高科的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除酒鬼酒、国轩高科之外，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出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,661.41
2	应收证券清算款	13,834.18
3	应收股利	-
4	应收利息	36,979.82
5	应收申购款	91,352.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	156,828.09

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	281,750.00	0.70	停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	----------	----------

				例 (%)	
1	605287	德才股份	8,268.72	0.02	新股未上市

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
5,288	4,706.77	7,199,000.00	28.92%	17,690,403.50	71.08%

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	16,342.05	0.07%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2018年12月07日) 基金份额总额	255,386,460.94
本报告期期初基金份额总额	29,742,545.77
本报告期基金总申购份额	8,709,741.77
减：本报告期基金总赎回份额	13,562,884.04

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	24,889,403.50

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

2021年3月9日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司关于总裁任职的公告》（临时信息披露[2021]1号），经本公司第三届董事会第二十次会议决议，并经中国银行保险监督管理委员会核准同意（银保监复〔2021〕159号），曾北川先生担任本公司总裁。2021年7月12日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司关于董事长任职的公告》（临时信息披露[2021]3号），经中国人民保险集团党委决定，并经中国银行保险监督管理委员会核准同意（银保监复〔2021〕519号），罗熹先生担任本公司非执行董事、董事长。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	14,637,445.51	49.83%	10,704.51	49.83%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	14,738,225.78	50.17%	10,778.19	50.17%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下：

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

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：

本基金本报告期内退租交易单元有：长城证券上交所交易单元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	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	1,786,685.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-12

	示性公告		
2	人保中证500指数型证券投资基金2021年资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-12
3	人保中证500指数型证券投资基金招募说明书更新(2021年第1号)	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-12
4	中国人保资产管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
5	人保中证500指数型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
6	中国人保资产管理有限公司旗下基金2021年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-22
7	人保中证500指数型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-22
8	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金投资范围新增存托凭证、增加侧袋机制、根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》修改法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-30
9	人保中证500指数型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-30
10	人保中证500指数型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-30
11	关于旗下基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-08
12	人保中证500指数型证券投资基金招募说明书更新(2021年第2号)	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-08

13	人保中证500指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-08
14	关于旗下部分基金新增阳光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	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-27
15	人保中证500指数型证券投资基金2021年基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-27
16	关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-29
17	人保中证500指数型证券投资基金招募说明书更新(2021年第3号)	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-29
18	人保中证500指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-29
19	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	中国证监会规定报刊及网站	2021-06-30
20	中国人保资产管理有限公司旗下基金2021年2季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-07-21
21	人保中证500指数型证券投资基金2021年第二季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021-07-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	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

类别	号	例达到或者超过 20%的时间区间					
机构	1	20210101-20210630	7,199,000.00	-	-	7,199,000.00	28.92%
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>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区西长安街88号中国人保大厦

基金托管人地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

中国人保资产管理有限公司
二〇二一年八月三十一日