

人保量化基本面混合型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 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:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023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信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）审计。

本报告期自2022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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	72
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	72
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	72
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	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	72
§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.....	74
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.....	74
§10 开放式基金份额变动.....	74
§11 重大事件揭示.....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
11.4 基金投资策略的改变.....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
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.....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
11.8 其他重大事件.....	77
§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	人保量化基本面混合型证券投资基金	
基金简称	人保量化混合	
基金主代码	006225	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年09月27日	
基金管理人	中国人保资产管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,729,276.95份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	人保量化混合A	人保量化混合C
下属分级基金的交易代码	006225	006226
报告期末下属分级基金的份额总额	1,176,555.82份	7,552,721.13份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金通过数量化方法，以人保量化基本面选股策略为主要投资策略，并通过多种辅助策略的配合，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。</p>
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括GDP增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金以价值投资理念及基本面分析方法为指导，利用数量化方法及计算机技术建立投资模型，将</p>

	<p>投资逻辑转化为明确的策略规则，以人保量化基本面选股策略为基础，并通过多种辅助策略的配合，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金基于投资策略及流动性管理的需要，将以有效利用基金资产、保持基金资产流动性、为基金资产提供稳定收益为主要目的，适时对债券等固定收益类金融工具进行投资。</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率×75%+中债综合全价指数收益率×20%+商业银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益率和预期风险低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	沈静
	联系电话	021-38571936
	电子邮箱	shengjing@piccamc.com
客户服务电话	400-820-7999	95588
传真	021-50765598	010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址	北京市西城区西长安街88号 中国人保大厦9层	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码	100031	100140
法定代表人	曾北川	陈四清

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	信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦A座8层
注册登记机构	中国人保资产管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元

§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

3.1.1 期间数据和指标	2022年		2021年		2020年	
	人保量化混合A	人保量化混合C	人保量化混合A	人保量化混合C	人保量化混合A	人保量化混合C
本期已实现收益	-30,580,362.79	-2,461,268.35	3,434,158.97	-766,118.50	13,453,690.47	197,316.92
本期利润	-31,433,912.58	-2,554,720.32	-3,279,446.84	-1,278,072.31	19,083,517.03	266,816.55
加权平均基金份额本期利润	-0.6691	-0.6257	-0.0653	-1.0788	0.3793	0.3543
本期加权平均净值利润率	-60.98%	-61.52%	-3.99%	-66.05%	28.11%	27.02%
本期基金份额净值增长率	-43.98%	-44.39%	-4.13%	-4.68%	32.49%	31.51%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末		2021年末		2020年末	

期末可供分配利润	-197,38 1.14	-1,456,1 81.81	23,853,0 65.87	1,456,16 6.06	20,281,3 30.87	138,808. 05
期末可供分配基金份额利润	-0.1678	-0.1928	0.4736	0.4392	0.4043	0.3797
期末基金资产净值	979,174. 68	6,096,53 9.32	74,825,7 43.88	4,813,02 9.84	77,728,8 73.69	556,704. 91
期末基金份额净值	0.8322	0.8072	1.4856	1.4515	1.5496	1.5227
3.1.3 累计期末指标	2022年末		2021年末		2020年末	
基金份额累计净值增长率	-16.78%	-19.28%	48.56%	45.15%	54.96%	52.27%

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

2、期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

人保量化混合A

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
过去三个月	-9.77%	1.33%	1.43%	0.88%	-11.20%	0.45%
过去六个月	-27.65%	1.44%	-9.46%	0.79%	-18.19%	0.65%
过去一年	-43.98%	1.51%	-16.04%	0.95%	-27.94%	0.56%
过去三年	-28.85%	1.59%	0.36%	0.95%	-29.21%	0.64%
自基金合同生效起至今	-16.78%	1.40%	14.54%	0.97%	-31.32%	0.43%

人保量化混合C

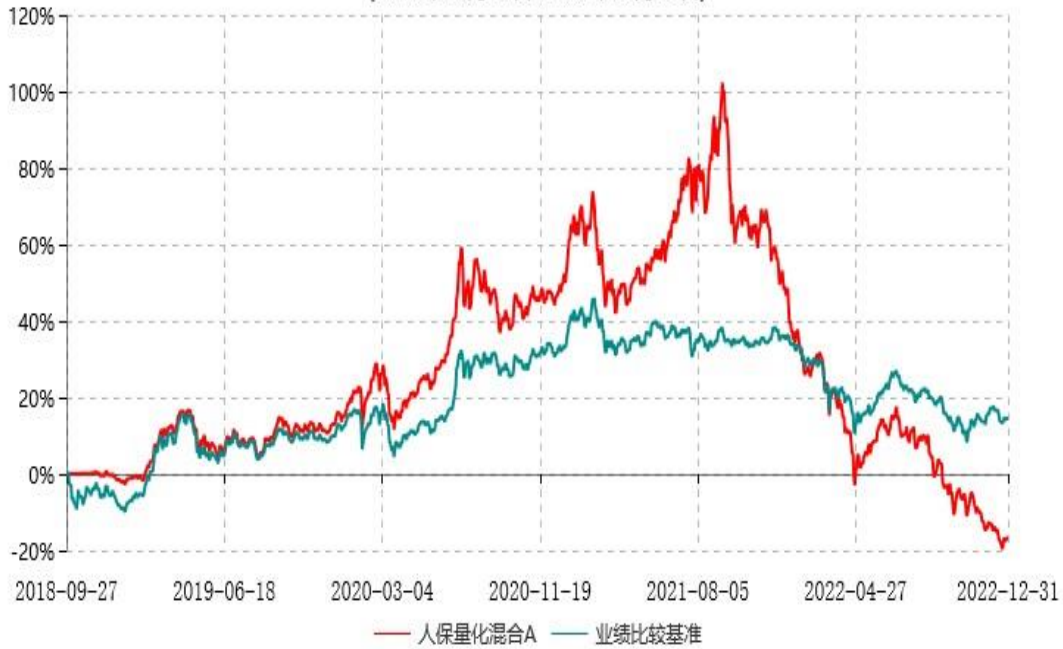
阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准 差②	基准收益 率③	基准收益 率标准 差④		
过去三个月	-9.98%	1.33%	1.43%	0.88%	-11.41%	0.45%
过去六个月	-27.92%	1.44%	-9.46%	0.79%	-18.46%	0.65%
过去一年	-44.39%	1.51%	-16.04%	0.95%	-28.35%	0.56%
过去三年	-30.29%	1.59%	0.36%	0.95%	-30.65%	0.64%
自基金合同 生效起至今	-19.28%	1.40%	14.54%	0.97%	-33.82%	0.43%

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

人保量化混合A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09月27日-2022年12月31日)

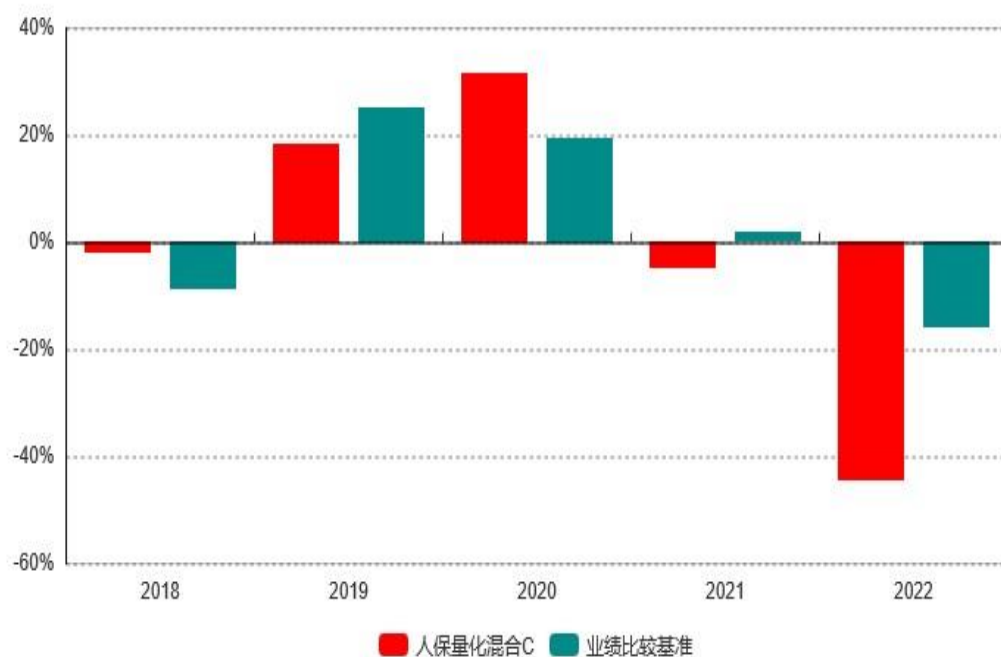
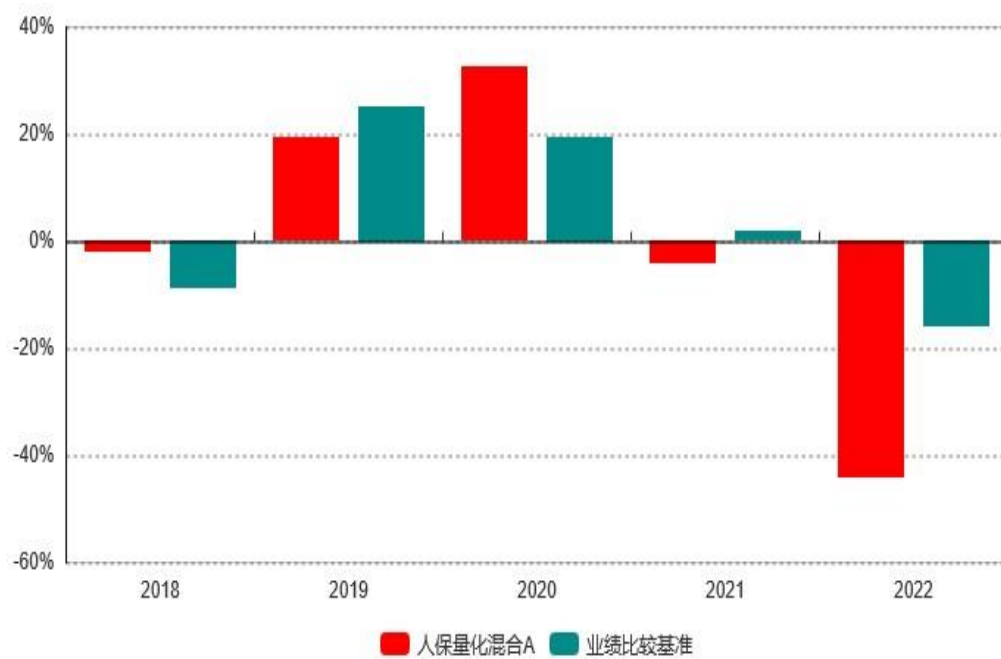


人保量化混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



- 注：1、本基金基金合同于2018年9月27日生效。根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月，建仓期结束，本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。
- 2、本基金业绩比较基准为：中证800指数收益率×75%+中债综合全价指数收益率×20%+商业银行活期存款利率×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

本基金过去三年未进行利润分配。

§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1.45万亿元人民币，具备银保监会核准的股票投资能力、无担保债券投资能力、股权投资能力、基础设施投资计划产品创新能力、不动产投资计划产品创新能力、衍生品运用能力和信托产品投资能力，具有国家外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。

成立十九年来，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。

十九年来，中国金融市场日趋成熟，财富管理行业日渐交融。人保资产科学筹划发展战略，积极把握第三方业务的发展机遇和另类资产的投资机会，在国内保险资产管理机构中较早开展了第三方保险机构的专户管理业务，并积极创新和开展股权投资、基础设施债权投资业务、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；十九年来，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“诚信、专业、创新、卓越”的企业核心价值观，实现“建设全球卓越保险集团”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2022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、人保中证500指数型证券投资基金、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）、人保量化锐进混合型发起式证券投资基金、人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金、人保利丰纯债债券型证券投资基金、人保安睿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保安和一年定期开放债券型发起式证券投资基金等。

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	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张永超	基金经理	2022-04-14	-	11年	清华大学工商管理硕士。曾任中信证券股份有限公司量化投资经理、北京乐正资本管理有限公司高级投资经理、中融国际信托有限公司投资经理；2016年3月至2020年6月在新华基金管理股份有限公司担任基金经理，曾任新华中证环保产业指数证券投资基金、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华

					<p>鑫丰灵活配置混合型证券投资基金、新华华盛灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、新华华荣灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华华丰灵活配置混合型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理。2020年7月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，2021年1月6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，2022年4月14日起任人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理。</p>
石晓冉	基金经理	2020-08-03	2022-09-19	5年	<p>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基金经理，2020年8月3日至2022年9月19日任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日至2022年4月1</p>

					9日任人保量化锐进混合型发起式证券投资基金基金经理，2022年4月14日起任人保优势产业混合型证券投资基金基金经理，2022年9月19日起任人保研究精选混合型证券投资基金、人保行业轮动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、2022年4月16日，公司发布了《人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2022年4月14日起增聘张永超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监管局备案。

4、2022年9月21日，公司发布了《人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2022年9月19日起解聘石晓冉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监管局备案。

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

2022年，战争、加息、疫情等多种因素共振，A股市场全年大幅波动，最终出现较大跌幅。自2017年至2021年，平均每年北上资金流入金额为2973亿元，2022年仅为900亿元，外资对A股也较为谨慎。全年来看，市场表现为快速轮动的特点，中信一级行业中，仅煤炭、消费者服务、交通运输3个行业上涨，27个行业下跌。

本基金没有战胜业绩基准，分析原因，主要在于持仓风格的暴露没有适应快速轮动的市场。我将不断完善策略，避免持仓风格过于集中，导致组合大幅偏离的情形；保持勤奋，提前“演练”各种措施以应对市场的变化；在量化因子方面，做到长短结合，提高组合的稳定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保量化混合A基金份额净值为0.8322元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-43.98%，同期业绩比较基准收益率为-16.04%；截至报告期末人保量化混合C基金份额净值为0.8072元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-44.39%，同期业绩比较基准收益率为-16.04%。

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2023年，内外部环境大概率出现改善，一方面，美联储加息接近尾声，给成长股的估值修复带来空间；另一方面，随着疫情防控政策的调整，经济活动恢复将推动经济回稳向上，有利于人民币汇率企稳和外资对A股信心的恢复。

综合来看，资本市场未来一年的表现是值得期待的，重点关注疫后复苏、高景气赛道等板块，并结合交易拥挤度、估值匹配程度等进行板块间的轮动。

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。会计师事务所在管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值委员会，成员主要由公募基金事业部相关领导、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债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种、流通受限股票等的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人--中国人保资产管理管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对中国人保资产管理管理有限公司编制和披露的本基金2022年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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	XYZH/2023BJAB1B0041

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	人保量化基本面混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了人保量化基本面混合型证券投资基

	<p>金的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表、净资产(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及中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了人保量化基本面混合型证券投资基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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,我们独立于人保量化基本面混合型证券投资基金,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。</p>
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。其他信息包括人保量化基本面混合型证券投资基金2022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。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及中

	<p>国证监会和中国证券投资基金业协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量化基本面混合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，除非基金管理人管理层计划清算人保量化基本面混合型证券投资基金、终止运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量化基本面混合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</p>

	可能导致对人保量化基本面混合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，未来的事项或情况可能导致人保量化基本面混合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、结构和内容(包括披露)，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	信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	崔巍巍、孟祥柱
会计师事务所的地址	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦A座8层
审计报告日期	2023-03-28

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：人保量化基本面混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	716,102.07	5,280,431.32
结算备付金		513,683.45	2,048,671.10
存出保证金		21,192.46	74,691.04
交易性金融资产	7.4.7.2	5,650,950.97	71,539,318.54

其中：股票投资		5,650,950.97	71,539,318.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		446,522.21	2,142,650.60
应收股利		-	-
应收申购款		21,146.06	29,738.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	1,582.49
资产总计		7,369,597.22	81,117,083.66
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
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		-	-
应付清算款		-	293,478.29
应付赎回款		42,447.40	19,878.54

应付管理人报酬		22,794.80	106,177.17
应付托管费		3,799.14	17,696.21
应付销售服务费		4,119.09	3,281.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	220,722.79	1,037,797.93
负债合计		293,883.22	1,478,309.94
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	8,729,276.95	53,683,972.69
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-1,653,562.95	25,954,801.03
净资产合计		7,075,714.00	79,638,773.72
负债和净资产总计		7,369,597.22	81,117,083.66

注：报告截止日2022年12月31日，人保量化混合A份额净值人民币0.8322元，基金份额总额1,176,555.82份；人保量化混合C份额净值人民币0.8072元，基金份额总额7,552,721.13份；总份额合计8,729,276.95份。

7.2 利润表

会计主体：人保量化基本面混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-32,881,961.44	1,274,260.77
1.利息收入		28,885.84	112,666.09
其中：存款利息收入	7.4.7.9	28,871.62	33,717.81
债券利息收入		-	44,387.21
资产支持证券利息收 入		-	-

买入返售金融资产收入		14.22	34,561.07
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-31,976,848.45	8,380,603.57
其中: 股票投资收益	7.4.7.10	-32,974,224.86	7,935,587.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-14,088.60
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	997,376.41	459,104.83
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-947,001.76	-7,225,559.62
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	13,002.93	6,550.73
减: 二、营业总支出		1,106,671.46	5,831,779.92
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	842,790.54	1,266,005.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	140,465.09	211,000.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	33,049.83	15,619.66
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-

7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.19	90,366.00	4,339,153.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-33,988,632.90	-4,557,519.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-33,988,632.90	-4,557,519.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-33,988,632.90	-4,557,519.15

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：人保量化基本面混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	53,683,972.69	-	25,954,801.03	79,638,773.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	53,683,972.69	-	25,954,801.03	79,638,773.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-44,954,695.74	-	-27,608,363.98	-72,563,059.72

(一)、综合收益总额	-	-	-33,988,632.90	-33,988,632.90
(二)、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)	-44,954,695.74	-	6,380,268.92	-38,574,426.82
其中: 1.基金申购款	8,872,702.94	-	-646,700.76	8,226,002.18
2.基金赎回款	-53,827,398.68	-	7,026,969.68	-46,800,429.00
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	8,729,276.95	-	-1,653,562.95	7,075,714.00
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	50,526,164.48	-	27,759,414.12	78,285,578.60
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	50,526,164.48	-	27,759,414.12	78,285,578.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,157,808.21	-	-1,804,613.09	1,353,195.12
（一）、综合收益总额	-	-	-4,557,519.15	-4,557,519.15
（二）、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）	3,157,808.21	-	2,752,906.06	5,910,714.27
其中：1.基金申购款	4,529,648.65	-	3,610,294.51	8,139,943.16
2.基金赎回款	-1,371,840.44	-	-857,388.45	-2,229,228.89
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	53,683,972.69	-	25,954,801.03	79,638,773.72

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

蔡红标

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

人保量化基本面混合型证券投资基金(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》、《人保量化基本面混合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]1089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239,917,928.20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00364号验资报告。基金合同于2018年9月27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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定,本基金份额分为A类基金份额(以下简称"人保量化混合A")和C类基金份额(以下简称"人保量化混合C")两类份额。其中,人保量化混合A是指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;人保量化混合C是指在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,但在赎回时收取赎回费,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

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,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、国债期货、股票期权、债券(含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单,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:股票投资占基金资产的比例为60%-95%;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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率 \times 75%+中债综合全价指数收益率 \times 20%+商业银行活期存款利率 \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》、应用指南、解释及其他相关规定,并参照中国证监会发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告

和中期报告》以及中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》等基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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2022年12月31日的财务状况以及2022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

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

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以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”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计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，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。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。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基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,将其公允价值划分为三个层次。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原则如下:

(1) 对存在活跃市场的投资品种,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。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的,应对市价进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场,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。

(3) 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,对估值进行调整,确定公允价值。

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,且该种法定权利现在是可执行的,同时交易双方计划以净额结算时,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的基金份额总额所对应的金额。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确认。

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

（1）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。

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。

（2）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与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。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。买卖债券价差收入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、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为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投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

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、相关交易费用与税费后的差额确认。

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。

（3）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。

（4）信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

（1）本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提。

（2）本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

（3）本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值0.80%的年费率逐日计提。

（4）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。

（5）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）由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本基金同一类别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

根据财政部发布的《企业会计准则第22号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号-金融资产转移》、《企业会计准则第24号-套期会计》和《企业会计准则第37号-金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

(1) 金融工具准则

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币5,280,431.32元，自应收利息转入的重分类金额为人民币531.44元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币5,280,962.76元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币2,048,671.10元，自应收利息转入的重分类金额为人民币1,014.09元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币2,049,685.19元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币74,691.04元，自应收利息转入的重分类金额为人民币36.96元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币74,728.00元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币1,582.49元，转出至银行存款的重分类金额为人民币531.44元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币1,014.09元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币36.96元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

(2) 修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日

活期存款	716,102.07	5,280,431.32
等于：本金	716,012.83	5,280,431.32
加：应计利息	89.24	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以 内	-	-
存款期限1-3个 月	-	-
存款期限3个月 以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	716,102.07	5,280,431.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,838,745.95	-	5,650,950.97	-187,794.98
贵金属投资-金交 所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,838,745.95	-	5,650,950.97	-187,794.98
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	70,780,111.76	-	71,539,318.54	759,206.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	70,780,111.76	-	71,539,318.54	759,206.78

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无衍生金融工具。

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无各项买入返售金融资产。

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无因买断式逆回购交易而取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	1,582.49

其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,582.49

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.24	0.82
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	210,722.55	1,007,797.11
其中：交易所市场	210,722.55	1,007,797.11
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	10,000.00	30,000.00
合计	220,722.79	1,037,797.93

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 人保量化混合A

金额单位：人民币元

项目 (人保量化混合A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	50,368,131.98	50,368,131.98
本期申购	1,531,412.28	1,531,412.28
本期赎回（以“-”号填列）	-50,722,988.44	-50,722,988.44
本期末	1,176,555.82	1,176,555.82

7.4.7.7.2 人保量化混合C

金额单位：人民币元

项目	本期

(人保量化混合C)	2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,315,840.71	3,315,840.71
本期申购	7,341,290.66	7,341,290.66
本期赎回(以“-”号填列)	-3,104,410.24	-3,104,410.24
本期末	7,552,721.13	7,552,721.13

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。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 人保量化混合A

单位：人民币元

项目 (人保量化混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	23,853,065.87	604,546.03	24,457,611.90
本期利润	-30,580,362.79	-853,549.79	-31,433,912.58
本期基金份额交易产生的变动数	6,540,987.23	237,932.31	6,778,919.54
其中：基金申购款	-36,120.99	-23,043.02	-59,164.01
基金赎回款	6,577,108.22	260,975.33	6,838,083.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-186,309.69	-11,071.45	-197,381.14

7.4.7.8.2 人保量化混合C

单位：人民币元

项目 (人保量化混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,456,166.06	41,023.07	1,497,189.13
本期利润	-2,461,268.35	-93,451.97	-2,554,720.32
本期基金份额交易产生的变动数	-385,869.59	-12,781.03	-398,650.62
其中：基金申购款	-530,558.05	-56,978.70	-587,536.75
基金赎回款	144,688.46	44,197.67	188,886.13

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,390,971.88	-65,209.93	-1,456,181.81

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	16,609.48	13,656.77
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	11,466.53	19,367.70
其他	795.61	693.34
合计	28,871.62	33,717.81

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	752,925,846.50	1,601,511,456.33
减：卖出股票成本总额	783,948,820.16	1,593,575,868.99
减：交易费用	1,951,251.20	-
买卖股票差价收入	-32,974,224.86	7,935,587.34

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	-	-

债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-	-14,088.60
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	-	-14,088.60

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	-	8,342,574.82
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	-	8,179,832.40
减：应计利息总额	-	176,831.02
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	-14,088.60

7.4.7.12 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。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14 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。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	997,376.41	459,104.83
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	997,376.41	459,104.83

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-947,001.76	-7,225,559.62
——股票投资	-947,001.76	-7,233,959.62
——债券投资	-	8,400.00
——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	-947,001.76	-7,225,559.62

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
基金赎回费收入	13,002.93	6,550.73
合计	13,002.93	6,550.73

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	10,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	366.00	384.00
交易费用	-	4,228,769.47
合计	90,366.00	4,339,153.47

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

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
中国工商银行股份有限公司	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

深圳市保腾盛私募股权基金管理有限公司	基金管理人控股子公司
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已经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均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 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	842,790.54	1,266,005.80
其中：支付销售机构的客户维护费	32,911.85	16,421.13

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×1.50%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×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	140,465.09	211,000.99

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%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×0.25%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保量化混合A	人保量化混合C	合计
中国工商 银行股份 有限公司	0.00	23,720.63	23,720.63
中国人保 资产管理 有限公司	0.00	100.29	100.29
合计	0.00	23,820.92	23,820.92
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保量化混合A	人保量化混合C	合计
中国工商 银行股份 有限公司	0.00	13,499.03	13,499.03
中国人保 资产管理	0.00	251.94	251.94

有限公司			
合计	0.00	13,750.97	13,750.97

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额：A类基金份额不收取销售服务费；C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值×0.80%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：C类基金份额每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.80%÷当年天数。

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

人保量化混合A

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国人民	0.00	0.00%	49,999,631.94	99.27%

人寿保险 股份有限 公司				
--------------------	--	--	--	--

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资人保量化混合C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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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
中国工商银行股份有限公司	716,102.07	16,609.48	5,280,431.32	13,656.77

注：本基金由基金托管人中国工商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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

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。公募基金事业部部务会为公募基金业务日常运行管理的议事机构，负责事业部经营管理重要事项的研究与决定，以及拟提交公司审批事项的审核。

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

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

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 2022年1 2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	716,102.07	-	-	-	716,102.07
结算备付金	513,683.45	-	-	-	513,683.45
存出保证金	21,192.46	-	-	-	21,192.46

交易性金融资产	-	-	-	5,650,950.97	5,650,950.97
应收清算款	-	-	-	446,522.21	446,522.21
应收申购款	-	-	-	21,146.06	21,146.06
资产总计	1,250,977.98	-	-	6,118,619.24	7,369,597.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	42,447.40	42,447.40
应付管理人报酬	-	-	-	22,794.80	22,794.80
应付托管费	-	-	-	3,799.14	3,799.14
应付销售服务费	-	-	-	4,119.09	4,119.09
其他负债	-	-	-	220,722.79	220,722.79
负债总计	-	-	-	293,883.22	293,883.22
利率敏感度缺口	1,250,977.98	-	-	5,824,736.02	7,075,714.00
上年度末 2021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	5,280,431.32	-	-	-	5,280,431.32
结算备付金	2,048,671.10	-	-	-	2,048,671.10
存出保证金	74,691.04	-	-	-	74,691.04
交易性金融资产	-	-	-	71,539,318.54	71,539,318.54
应收证券清算款	-	-	-	2,142,650.60	2,142,650.60

应收申购款	-	-	-	29,738.57	29,738.57
其他资产	-	-	-	1,582.49	1,582.49
资产总计	7,403,793.46	-	-	73,713,290.20	81,117,083.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	293,478.29	293,478.29
应付赎回款	-	-	-	19,878.54	19,878.54
应付管理人报酬	-	-	-	106,177.17	106,177.17
应付托管费	-	-	-	17,696.21	17,696.21
应付销售服务费	-	-	-	3,281.80	3,281.80
其他负债	-	-	-	1,037,797.93	1,037,797.93
负债总计	-	-	-	1,478,309.94	1,478,309.94
利率敏感度缺口	7,403,793.46	-	-	72,234,980.26	79,638,773.72

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均无债券投资，因此，市场利率的变动对基金资产净值无重大影响。

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 2022年12月31日		上年度末 2021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	5,650,950.97	79.86	71,539,318.54	89.83
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	5,650,950.97	79.86	71,539,318.54	89.83

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	1.业绩比较基准增加5%	34,193.62	4,114,945.54
2.业绩比较基准减少5%	-34,193.62	-4,114,945.54	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	5,650,950.97	71,533,814.05
第二层次	-	5,504.49
第三层次	-	-
合计	5,650,950.97	71,539,318.54

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	5,650,950.97	76.68
	其中：股票	5,650,950.97	76.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,229,785.52	16.69
8	其他各项资产	488,860.73	6.63
9	合计	7,369,597.22	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	241,275.00	3.41
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,673,845.13	66.05
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	55,965.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	264,333.00	3.74
I	信息传输、软件和信息技术服务业	330,696.84	4.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	84,836.00	1.20
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	5,650,950.97	79.86

8.2.2 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

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	688456	有研粉材	9,483	322,422.00	4.56
2	300633	开立医疗	5,200	285,116.00	4.03

3	688100	威胜信息	11,681	269,714.29	3.81
4	605108	同庆楼	7,100	264,333.00	3.74
5	300308	中际旭创	9,300	251,379.00	3.55
6	603290	斯达半导	700	230,510.00	3.26
7	688200	华峰测控	663	183,299.61	2.59
8	688630	芯碁微装	2,130	177,727.20	2.51
9	603185	上机数控	1,600	169,360.00	2.39
10	600160	巨化股份	9,900	153,549.00	2.17
11	002138	顺络电子	5,700	149,226.00	2.11
12	603086	先达股份	11,200	146,608.00	2.07
13	605060	联德股份	5,600	144,536.00	2.04
14	300661	圣邦股份	800	138,080.00	1.95
15	688798	艾为电子	1,445	138,040.85	1.95
16	603986	兆易创新	1,300	133,211.00	1.88
17	688608	恒玄科技	1,090	124,260.00	1.76
18	601012	隆基绿能	2,900	122,554.00	1.73
19	002409	雅克科技	2,400	120,888.00	1.71
20	002299	圣农发展	5,100	120,819.00	1.71
21	002982	湘佳股份	2,800	120,456.00	1.70
22	688589	力合微	3,547	119,959.54	1.70
23	300782	卓胜微	1,000	114,300.00	1.62
24	600529	山东药玻	3,900	110,760.00	1.57
25	002938	鹏鼎控股	4,000	109,760.00	1.55
26	002123	梦网科技	9,500	106,685.00	1.51
27	603609	禾丰股份	8,800	104,192.00	1.47
28	603501	韦尔股份	1,300	100,217.00	1.42
29	300502	新易盛	4,100	97,375.00	1.38
30	002560	通达股份	13,700	93,434.00	1.32
31	002965	祥鑫科技	1,600	93,136.00	1.32
32	002027	分众传媒	12,700	84,836.00	1.20
33	002085	万丰奥威	14,000	83,300.00	1.18

34	002045	国光电器	6,600	81,774.00	1.16
35	603990	麦迪科技	4,190	79,903.30	1.13
36	002955	鸿合科技	2,900	68,295.00	0.97
37	000831	中国稀土	2,000	65,760.00	0.93
38	688297	中无人机	1,346	60,475.78	0.85
39	603529	爱玛科技	1,300	59,631.00	0.84
40	600058	五矿发展	6,500	55,965.00	0.79
41	688559	海目星	914	52,865.76	0.75
42	001301	尚太科技	815	48,117.60	0.68
43	600161	天坛生物	1,648	39,107.04	0.55
44	600438	通威股份	800	30,864.00	0.44
45	300465	高伟达	3,100	24,149.00	0.34

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	600011	华能国际	7,345,989.00	9.22
2	002756	永兴材料	6,927,630.60	8.70
3	002738	中矿资源	6,818,126.00	8.56
4	002466	天齐锂业	6,002,425.78	7.54
5	688005	容百科技	5,783,200.44	7.26
6	002129	TCL中环	5,730,999.00	7.20
7	688599	天合光能	5,712,803.93	7.17
8	000733	振华科技	5,643,766.00	7.09
9	002594	比亚迪	5,441,541.00	6.83
10	601677	明泰铝业	5,032,188.00	6.32
11	603668	天马科技	4,961,287.00	6.23
12	002240	盛新锂能	4,787,623.00	6.01
13	600160	巨化股份	4,675,836.12	5.87

14	000933	神火股份	4,628,898.00	5.81
15	300504	天邑股份	4,544,429.00	5.71
16	002906	华阳集团	4,381,485.00	5.50
17	601689	拓普集团	4,344,414.96	5.46
18	601001	晋控煤业	4,335,935.00	5.44
19	600367	红星发展	4,298,729.00	5.40
20	000657	中钨高新	4,169,072.00	5.23
21	600438	通威股份	4,119,124.81	5.17
22	300035	中科电气	4,088,194.00	5.13
23	300856	科思股份	4,084,319.00	5.13
24	002245	蔚蓝锂芯	4,018,648.00	5.05
25	603990	麦迪科技	3,999,643.00	5.02
26	600481	双良节能	3,988,561.00	5.01
27	600004	白云机场	3,956,496.00	4.97
28	603688	石英股份	3,933,954.00	4.94
29	600499	科达制造	3,872,894.00	4.86
30	603995	甬金股份	3,863,757.00	4.85
31	601012	隆基绿能	3,812,802.00	4.79
32	300398	飞凯材料	3,748,138.00	4.71
33	000683	远兴能源	3,738,769.00	4.69
34	600546	山煤国际	3,680,539.00	4.62
35	600057	厦门象屿	3,668,242.00	4.61
36	600027	华电国际	3,641,726.00	4.57
37	603345	安井食品	3,635,190.60	4.56
38	688200	华峰测控	3,628,462.64	4.56
39	300593	新雷能	3,515,280.00	4.41
40	000726	鲁泰 A	3,432,347.00	4.31
41	600188	兖矿能源	3,413,572.00	4.29
42	000887	中鼎股份	3,389,719.00	4.26
43	600048	保利发展	3,372,156.00	4.23
44	000970	中科三环	3,353,491.79	4.21

45	605060	联德股份	3,343,492.00	4.20
46	688308	欧科亿	3,317,471.39	4.17
47	688301	奕瑞科技	3,290,284.04	4.13
48	601225	陕西煤业	3,242,309.00	4.07
49	000519	中兵红箭	3,227,192.00	4.05
50	301035	润丰股份	3,197,169.00	4.01
51	688668	鼎通科技	3,180,819.50	3.99
52	601636	旗滨集团	3,168,140.00	3.98
53	600089	特变电工	3,138,550.00	3.94
54	601872	招商轮船	3,134,674.00	3.94
55	000625	长安汽车	3,115,662.00	3.91
56	002812	恩捷股份	3,108,849.38	3.90
57	688608	恒玄科技	3,091,489.71	3.88
58	000963	华东医药	3,079,390.00	3.87
59	002460	赣锋锂业	3,059,716.00	3.84
60	600765	中航重机	3,047,457.00	3.83
61	002472	双环传动	3,042,343.00	3.82
62	300861	美畅股份	3,018,346.40	3.79
63	600256	广汇能源	3,003,276.00	3.77
64	300613	富瀚微	2,998,975.50	3.77
65	002714	牧原股份	2,990,342.00	3.75
66	603871	嘉友国际	2,974,523.00	3.74
67	603799	华友钴业	2,973,858.00	3.73
68	300481	濮阳惠成	2,953,070.00	3.71
69	000568	泸州老窖	2,943,877.00	3.70
70	603339	四方科技	2,923,249.56	3.67
71	603019	中科曙光	2,909,424.00	3.65
72	300363	博腾股份	2,900,904.91	3.64
73	688589	力合微	2,880,835.39	3.62
74	601699	潞安环能	2,876,822.00	3.61
75	300571	平治信息	2,871,872.00	3.61

76	600150	中国船舶	2,839,314.00	3.57
77	688601	力芯微	2,839,197.66	3.57
78	000762	西藏矿业	2,838,991.00	3.56
79	603290	斯达半导	2,833,504.00	3.56
80	605117	德业股份	2,826,813.00	3.55
81	002001	新和成	2,815,582.00	3.54
82	688122	西部超导	2,782,131.53	3.49
83	300308	中际旭创	2,751,335.00	3.45
84	688063	派能科技	2,731,781.82	3.43
85	300358	楚天科技	2,715,358.00	3.41
86	002375	亚厦股份	2,691,998.00	3.38
87	002487	大金重工	2,686,884.00	3.37
88	603565	中谷物流	2,648,434.70	3.33
89	300570	太辰光	2,606,082.00	3.27
90	002212	天融信	2,605,858.00	3.27
91	601658	邮储银行	2,603,606.00	3.27
92	002705	新宝股份	2,542,911.00	3.19
93	000977	浪潮信息	2,525,085.00	3.17
94	603938	三孚股份	2,523,230.00	3.17
95	688099	晶晨股份	2,518,065.62	3.16
96	603529	爱玛科技	2,515,856.00	3.16
97	688357	建龙微纳	2,514,221.98	3.16
98	300755	华致酒行	2,512,093.00	3.15
99	603876	鼎胜新材	2,506,737.00	3.15
100	601231	环旭电子	2,497,911.00	3.14
101	002123	梦网科技	2,487,873.00	3.12
102	688100	威胜信息	2,483,461.57	3.12
103	600010	包钢股份	2,476,974.00	3.11
104	603063	禾望电气	2,466,051.00	3.10
105	002615	哈尔斯	2,444,463.00	3.07
106	300684	中石科技	2,443,012.00	3.07

107	605123	派克新材	2,430,532.00	3.05
108	600929	雪天盐业	2,417,908.00	3.04
109	300073	当升科技	2,417,254.00	3.04
110	002821	凯莱英	2,414,186.37	3.03
111	000408	藏格矿业	2,397,424.00	3.01
112	688456	有研粉材	2,390,639.98	3.00
113	300438	鹏辉能源	2,390,316.00	3.00
114	002182	云海金属	2,385,978.00	3.00
115	000423	东阿阿胶	2,347,520.00	2.95
116	605555	德昌股份	2,328,732.20	2.92
117	600325	华发股份	2,320,121.00	2.91
118	688196	卓越新能	2,296,430.29	2.88
119	000893	亚钾国际	2,286,378.00	2.87
120	605111	新洁能	2,265,237.12	2.84
121	688077	大地熊	2,259,511.54	2.84
122	002291	遥望科技	2,246,955.00	2.82
123	300999	金龙鱼	2,242,535.44	2.82
124	002078	太阳纸业	2,242,174.00	2.82
125	603606	东方电缆	2,236,367.00	2.81
126	300373	扬杰科技	2,223,207.02	2.79
127	601899	紫金矿业	2,202,038.00	2.77
128	300118	东方日升	2,148,855.00	2.70
129	002371	北方华创	2,142,206.00	2.69
130	600487	亨通光电	2,107,109.00	2.65
131	605296	神农集团	2,098,473.20	2.63
132	603129	春风动力	2,095,372.00	2.63
133	600426	华鲁恒升	2,089,591.71	2.62
134	300327	中颖电子	2,086,812.20	2.62
135	600111	北方稀土	2,084,885.00	2.62
136	603589	口子窖	2,055,089.00	2.58
137	300633	开立医疗	2,054,285.00	2.58

138	603214	爱婴室	2,048,683.00	2.57
139	603786	科博达	2,039,263.00	2.56
140	300673	佩蒂股份	2,017,223.76	2.53
141	002364	中恒电气	1,997,967.00	2.51
142	300772	运达股份	1,995,493.00	2.51
143	002312	川发龙蟒	1,970,256.00	2.47
144	002920	德赛西威	1,956,421.00	2.46
145	301349	信德新材	1,954,590.00	2.45
146	003011	海象新材	1,954,536.40	2.45
147	600233	圆通速递	1,947,149.00	2.44
148	600563	法拉电子	1,938,538.10	2.43
149	688037	芯源微	1,931,632.66	2.43
150	600519	贵州茅台	1,921,453.00	2.41
151	002585	双星新材	1,920,953.00	2.41
152	605108	同庆楼	1,918,877.20	2.41
153	600161	天坛生物	1,918,617.56	2.41
154	300910	瑞丰新材	1,915,196.00	2.40
155	300604	长川科技	1,909,904.00	2.40
156	688268	华特气体	1,896,820.16	2.38
157	000792	盐湖股份	1,886,369.00	2.37
158	300390	天华超净	1,861,154.00	2.34
159	600315	上海家化	1,850,153.00	2.32
160	002407	多氟多	1,839,727.00	2.31
161	000831	中国稀土	1,729,516.00	2.17
162	601128	常熟银行	1,716,118.00	2.15
163	300014	亿纬锂能	1,715,659.99	2.15
164	002385	大北农	1,713,571.00	2.15
165	688578	艾力斯	1,704,328.19	2.14
166	003032	传智教育	1,701,673.00	2.14
167	300587	天铁股份	1,683,171.00	2.11
168	300890	翔丰华	1,678,442.00	2.11

169	002497	雅化集团	1,663,561.00	2.09
170	300520	科大国创	1,658,090.00	2.08
171	002459	晶澳科技	1,655,449.63	2.08
172	600096	云天化	1,649,045.00	2.07
173	002258	利尔化学	1,644,053.00	2.06
174	688800	瑞可达	1,640,297.80	2.06
175	002518	科士达	1,639,553.00	2.06
176	002009	天奇股份	1,632,634.00	2.05
177	688400	凌云光	1,629,693.35	2.05
178	601991	大唐发电	1,625,304.00	2.04
179	002155	湖南黄金	1,618,328.00	2.03
180	002270	华明装备	1,617,437.00	2.03
181	601339	百隆东方	1,610,404.00	2.02
182	688041	海光信息	1,606,493.32	2.02
183	002391	长青股份	1,606,298.00	2.02
184	003022	联泓新科	1,604,808.00	2.02

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 累计卖出金额超初期基金资产净值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	600011	华能国际	9,287,165.80	11.66
2	002756	永兴材料	7,972,921.00	10.01
3	002738	中矿资源	6,901,141.20	8.67
4	688599	天合光能	6,708,928.41	8.42
5	000733	振华科技	6,331,431.00	7.95
6	601677	明泰铝业	6,227,667.00	7.82
7	002466	天齐锂业	6,094,134.00	7.65
8	002594	比亚迪	6,084,578.00	7.64
9	002240	盛新锂能	5,608,999.00	7.04

10	002129	TCL中环	5,608,415.00	7.04
11	688005	容百科技	5,404,709.23	6.79
12	600027	华电国际	5,355,688.00	6.72
13	603995	甬金股份	5,282,276.00	6.63
14	600048	保利发展	4,968,603.00	6.24
15	600057	厦门象屿	4,954,118.00	6.22
16	002245	蔚蓝锂芯	4,936,780.90	6.20
17	600499	科达制造	4,910,627.00	6.17
18	000657	中钨高新	4,744,425.00	5.96
19	600367	红星发展	4,607,507.00	5.79
20	603668	天马科技	4,580,350.00	5.75
21	002906	华阳集团	4,575,615.00	5.75
22	601001	晋控煤业	4,524,770.00	5.68
23	002001	新和成	4,459,198.00	5.60
24	000933	神火股份	4,410,085.00	5.54
25	300504	天邑股份	4,398,856.00	5.52
26	601689	拓普集团	4,378,745.44	5.50
27	600188	兖矿能源	4,359,347.00	5.47
28	600546	山煤国际	4,291,470.00	5.39
29	601636	旗滨集团	4,289,229.00	5.39
30	600160	巨化股份	4,270,733.00	5.36
31	000963	华东医药	4,192,626.00	5.26
32	600438	通威股份	4,148,824.00	5.21
33	600481	双良节能	4,081,673.00	5.13
34	000568	泸州老窖	4,073,151.00	5.11
35	300856	科思股份	4,033,468.00	5.06
36	603688	石英股份	4,006,516.00	5.03
37	000887	中鼎股份	3,998,644.00	5.02
38	600765	中航重机	3,984,110.00	5.00
39	603799	华友钴业	3,949,851.00	4.96
40	300035	中科电气	3,933,423.33	4.94

41	600004	白云机场	3,890,127.00	4.88
42	600519	贵州茅台	3,846,904.00	4.83
43	002472	双环传动	3,762,843.00	4.72
44	688301	奕瑞科技	3,697,315.90	4.64
45	000519	中兵红箭	3,625,374.00	4.55
46	603990	麦迪科技	3,597,178.90	4.52
47	601012	隆基绿能	3,591,990.04	4.51
48	300398	飞凯材料	3,555,508.00	4.46
49	603345	安井食品	3,392,579.00	4.26
50	688668	鼎通科技	3,391,734.61	4.26
51	000726	鲁泰 A	3,376,380.00	4.24
52	000683	远兴能源	3,339,726.65	4.19
53	600150	中国船舶	3,336,984.00	4.19
54	600563	法拉电子	3,314,550.20	4.16
55	688308	欧科亿	3,304,136.54	4.15
56	300593	新雷能	3,300,881.00	4.14
57	601872	招商轮船	3,276,812.00	4.11
58	300118	东方日升	3,205,834.04	4.03
59	300750	宁德时代	3,169,286.00	3.98
60	301035	润丰股份	3,148,086.00	3.95
61	601225	陕西煤业	3,128,314.00	3.93
62	688200	华峰测控	3,125,526.01	3.92
63	000792	盐湖股份	3,100,122.00	3.89
64	002460	赣锋锂业	3,046,561.00	3.83
65	688589	力合微	3,008,861.52	3.78
66	603339	四方科技	3,006,435.00	3.78
67	600256	广汇能源	2,985,299.00	3.75
68	603871	嘉友国际	2,962,729.38	3.72
69	300613	富瀚微	2,958,044.50	3.71
70	000625	长安汽车	2,911,409.00	3.66
71	300363	博腾股份	2,901,560.00	3.64

72	605060	联德股份	2,878,141.00	3.61
73	002271	东方雨虹	2,872,070.00	3.61
74	000970	中科三环	2,864,784.60	3.60
75	600089	特变电工	2,826,534.00	3.55
76	605123	派克新材	2,820,880.00	3.54
77	603019	中科曙光	2,802,116.00	3.52
78	002812	恩捷股份	2,782,400.00	3.49
79	300861	美畅股份	2,778,542.20	3.49
80	002487	大金重工	2,753,200.00	3.46
81	688601	力芯微	2,751,700.68	3.46
82	601615	明阳智能	2,725,404.00	3.42
83	601991	大唐发电	2,725,368.00	3.42
84	300014	亿纬锂能	2,724,457.00	3.42
85	300481	濮阳惠成	2,714,629.00	3.41
86	601699	潞安环能	2,696,861.00	3.39
87	605117	德业股份	2,665,739.00	3.35
88	300571	平治信息	2,640,485.00	3.32
89	002714	牧原股份	2,634,220.20	3.31
90	000762	西藏矿业	2,631,848.00	3.30
91	603529	爱玛科技	2,625,606.80	3.30
92	688122	西部超导	2,604,699.64	3.27
93	600905	三峡能源	2,594,778.69	3.26
94	603290	斯达半导	2,587,333.00	3.25
95	601658	邮储银行	2,579,376.00	3.24
96	300308	中际旭创	2,552,159.00	3.20
97	002385	大北农	2,545,531.00	3.20
98	688608	恒玄科技	2,526,678.57	3.17
99	002375	亚厦股份	2,510,313.00	3.15
100	300776	帝尔激光	2,509,277.20	3.15
101	688456	有研粉材	2,503,899.05	3.14
102	300358	楚天科技	2,490,004.00	3.13

103	600795	国电电力	2,450,928.00	3.08
104	600929	雪天盐业	2,442,680.00	3.07
105	688099	晶晨股份	2,431,087.67	3.05
106	688568	中科星图	2,419,014.75	3.04
107	300570	太辰光	2,411,143.00	3.03
108	688196	卓越新能	2,395,134.81	3.01
109	002212	天融信	2,391,698.00	3.00
110	600111	北方稀土	2,386,185.00	3.00
111	000408	藏格矿业	2,379,429.00	2.99
112	603938	三孚股份	2,370,739.00	2.98
113	000977	浪潮信息	2,367,536.00	2.97
114	601231	环旭电子	2,352,663.69	2.95
115	600010	包钢股份	2,345,134.00	2.94
116	603606	东方电缆	2,330,439.00	2.93
117	300755	华致酒行	2,322,042.00	2.92
118	600325	华发股份	2,315,200.00	2.91
119	002182	云海金属	2,310,107.84	2.90
120	000893	亚钾国际	2,304,076.00	2.89
121	688077	大地熊	2,286,544.37	2.87
122	002009	天奇股份	2,286,149.00	2.87
123	603786	科博达	2,281,568.00	2.86
124	605555	德昌股份	2,272,849.40	2.85
125	603565	中谷物流	2,251,214.20	2.83
126	688100	威胜信息	2,244,515.23	2.82
127	603063	禾望电气	2,217,706.00	2.78
128	688357	建龙微纳	2,213,695.48	2.78
129	002123	梦网科技	2,177,570.00	2.73
130	002291	遥望科技	2,161,253.00	2.71
131	002705	新宝股份	2,151,441.00	2.70
132	601208	东材科技	2,146,359.00	2.70
133	000423	东阿阿胶	2,124,339.00	2.67

134	300438	鹏辉能源	2,104,373.00	2.64
135	002371	北方华创	2,100,757.00	2.64
136	002078	太阳纸业	2,100,457.00	2.64
137	688063	派能科技	2,091,190.45	2.63
138	002821	凯莱英	2,076,303.00	2.61
139	605296	神农集团	2,060,005.10	2.59
140	605111	新洁能	2,047,844.00	2.57
141	300373	扬杰科技	2,016,221.02	2.53
142	300390	天华超净	2,003,813.00	2.52
143	002615	哈尔斯	2,002,041.00	2.51
144	300260	新莱应材	1,997,545.00	2.51
145	301349	信德新材	1,982,167.58	2.49
146	300673	佩蒂股份	1,965,645.88	2.47
147	002364	中恒电气	1,963,964.00	2.47
148	603589	口子窖	1,951,283.00	2.45
149	600426	华鲁恒升	1,944,886.00	2.44
150	600487	亨通光电	1,939,539.00	2.44
151	300999	金龙鱼	1,938,545.20	2.43
152	300684	中石科技	1,930,572.00	2.42
153	603279	景津装备	1,928,200.50	2.42
154	603876	鼎胜新材	1,922,461.00	2.41
155	600233	圆通速递	1,890,198.00	2.37
156	300073	当升科技	1,889,717.00	2.37
157	300604	长川科技	1,888,799.00	2.37
158	300059	东方财富	1,867,024.40	2.34
159	002312	川发龙蟒	1,863,418.00	2.34
160	601899	紫金矿业	1,841,419.00	2.31
161	300633	开立医疗	1,831,817.00	2.30
162	002407	多氟多	1,815,882.00	2.28
163	605108	同庆楼	1,807,431.00	2.27
164	688268	华特气体	1,804,344.85	2.27

165	600096	云天化	1,788,324.00	2.25
166	003011	海象新材	1,781,794.00	2.24
167	300910	瑞丰新材	1,780,670.00	2.24
168	300327	中颖电子	1,767,382.67	2.22
169	600161	天坛生物	1,764,223.00	2.22
170	002920	德赛西威	1,741,394.00	2.19
171	300772	运达股份	1,738,423.10	2.18
172	603214	爱婴室	1,735,613.00	2.18
173	603129	春风动力	1,725,715.00	2.17
174	002459	晶澳科技	1,721,870.00	2.16
175	002258	利尔化学	1,718,367.20	2.16
176	300587	天铁股份	1,708,370.04	2.15
177	600938	中国海油	1,699,817.96	2.13
178	600873	梅花生物	1,696,097.22	2.13
179	688037	芯源微	1,694,884.33	2.13
180	601128	常熟银行	1,687,957.00	2.12
181	600893	航发动力	1,673,691.00	2.10
182	600315	上海家化	1,672,077.00	2.10
183	688400	凌云光	1,648,188.69	2.07
184	002120	韵达股份	1,616,987.00	2.03
185	002155	湖南黄金	1,609,859.00	2.02
186	002585	双星新材	1,605,921.00	2.02
187	003032	传智教育	1,604,331.00	2.01

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	719,007,454.35
卖出股票收入（成交）总额	752,925,846.50

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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投资。

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

威胜信息（代码：688100.SH）为本基金前十大持仓证券。2022年1月26日，威胜信息收到上海证券交易所监管关注，未依法履行其他职责，在减持过程中超比例减持约13.3万股，占公司总股本的0.03%。根据《中华人民共和国证券法(2019年修订)》第63条、《上市公司收购管理办法》第13条、《上海证券交易所科创板股票上市规则》第1.4条、第14.2.2条、《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》规定，予以监管警示。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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	21,192.46
2	应收清算款	446,522.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,146.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	488,860.73

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

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

份额 级别	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
人保 量化	543	2,166.77	0.00	0.00%	1,176,555.82	100.0 0%

混合A						
人保 量化 混合C	1,5 19	4,972.17	0.00	0.00%	7,552,721.13	100.0 0%
合计	1,9 11	4,567.91	0.00	0.00%	8,729,276.95	100.0 0%

注：机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	人保量化混合A	108.90	0.01%
	人保量化混合C	10,778.23	0.14%
	合计	10,887.13	0.12%

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	份额级别	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	人保量化混合A	0
	人保量化混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	人保量化混合A	0
	人保量化混合C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	人保量化混合A	人保量化混合C
基金合同生效日(2018年09月27	54,043,539.14	185,874,389.06

日)基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	50,368,131.98	3,315,840.71
本报告期基金总申购份额	1,531,412.28	7,341,290.66
减：本报告期基金总赎回份额	50,722,988.44	3,104,410.24
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,176,555.82	7,552,721.13

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

2022年12月28日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司公募基金业务高级管理人员变更公告》，2022年12月26日公募基金事业部合规负责人（督察长）吕传红因个人原因离任，由蔡红标代行公募基金事业部合规负责人（督察长）职务。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本基金本报告期审计机构由德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）变更为信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期应支付给信永中和会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费用为10,000.00元。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
-----	----

受到稽查或处罚等措施的主体	中国人保资产管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2022-05-23
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	北京证监局行政监管措施决定书（2022）88号
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	完成整改。
其他	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员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	
光大证券	1	697,837,304.94	47.44%	510,332.79	47.44%	-
招商证券	1	773,018,700.35	52.56%	565,307.19	52.56%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下：

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

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。

11.7.2 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
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	200,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-05
2	中国人保资产管理有限公司董事变动情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-18
3	关于旗下部分基金参与中国人寿保险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	2022-01-24
4	中国人保资产管理有限公司旗下基金2021年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-24
5	人保量化基本面混合型证券投资基金2021年第四季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-24
6	关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-29

	的提示性公告		
7	人保量化基本面混合型证券投资基金招募说明书更新(2022年第1号)	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-29
8	人保量化基本面混合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	2022-03-29
9	关于旗下部分基金2021年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-31
10	人保量化基本面混合型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-31
11	人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-16
12	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	2022-04-19
13	人保量化基本面混合型证券投资基金招募说明书更新(2022年第2号)	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-19
14	人保量化基本面混合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	2022-04-19
15	关于旗下部分基金2022年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-22
16	人保量化基本面混合型证券投资基金2022年第一季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-22
17	中国人保资产管理有限公司关于营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-26
18	关于旗下基金2022年2季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-07-20
19	人保量化基本面混合型证券投资基金2022年第二季度报	中国证监会规定报刊及网站	2022-07-20

	告		
20	关于旗下基金在部分销售机构暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-07-20
21	关于旗下基金2022年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-08-30
22	人保量化基本面混合型证券投资基金2022年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2022-08-30
23	人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-09-21
24	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	2022-09-22
25	人保量化基本面混合型证券投资基金招募说明书更新(2022年第3号)	中国证监会规定报刊及网站	2022-09-22
26	人保量化基本面混合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	2022-09-22
27	关于旗下基金2022年3季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-10-25
28	人保量化基本面混合型证券投资基金2022年第三季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022-10-25
29	关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-11-05
30	中国人保资产管理有限公司公募基金业务高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-12-28

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20221211	49,999,631.94	-	49,999,631.94	-	-
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量化基本面混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《人保量化基本面混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《人保量化基本面混合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、报告期内人保量化基本面混合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

基金托管人地址：北京市西城区复兴门内大街55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

二〇二三年三月三十日