

人保中证 500 指数型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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:2026 年 08 月 29 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66

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.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	67
§10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	68
10.8 其他重大事件	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
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.....	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点.....	72
12.3 查阅方式.....	72

§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	30,173,356.48份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	人保中证500A	人保中证500C
下属分级基金的交易代码	006611	023498
报告期末下属分级基金的份额总额	29,731,450.15份	441,906.33份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中国人保资产管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭乐琦	方圆
	联系电话	021-38572076	95559
	电子邮箱	guolq@piccamc.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-820-7999	95559
传真		021-50765598	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		100031	200336
法定代表人		黄明	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金中期报告置备地点	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国人保资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	人保中证500A	人保中证500C
本期已实现收益	5,699,253.13	52,661.43
本期利润	11,379,181.43	71,384.43
加权平均基金份额本期利润	0.3723	0.3515
本期加权平均净值利润率	17.85%	16.87%
本期基金份额净值增长率	20.48%	20.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	人保中证500A	人保中证500C
期末可供分配利润	37,996,001.71	366,192.31
期末可供分配基金份额利润	1.2780	0.8287
期末基金资产净值	67,727,451.86	1,001,587.63
期末基金份额净值	2.2780	2.2665
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	人保中证500A	人保中证500C
基金份额累计净值增长率	127.80%	52.87%

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

人保中证500A

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	18.15%	1.55%	17.61%	1.56%	0.54%	-0.01%
过去六个月	20.48%	1.56%	19.93%	1.58%	0.55%	-0.02%
过去一年	50.79%	1.33%	49.68%	1.35%	1.11%	-0.02%
过去三年	51.70%	1.39%	48.15%	1.41%	3.55%	-0.02%
过去五年	39.93%	1.27%	31.61%	1.30%	8.32%	-0.03%
过去七年	104.69%	1.27%	78.59%	1.29%	26.10%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	127.80%	1.29%	99.48%	1.32%	28.32%	-0.03%

人保中证500C

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	18.03%	1.55%	17.61%	1.56%	0.42%	-0.01%
过去六个月	20.25%	1.56%	19.93%	1.58%	0.32%	-0.02%
过去一年	50.21%	1.33%	49.68%	1.35%	0.53%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	52.87%	1.31%	47.07%	1.34%	5.80%	-0.03%

注：本基金自2025年2月28日起增加C类份额。

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500A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-2026年06月30日)



人保中证500C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年02月28日-2026年06月30日)



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

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中国人保资产管理有限公司成立于2003年7月，系境内第一家保险资产管理公司，受托对人保集团内保险资金以及第三方资金实施集中化、专业化和市场化的投资管理，目前管理资产总规模近2万亿元。

公司拥有信用风险管理、股票投资管理、衍生品运用管理（股指期货和国债期货）、债权投资计划产品管理、股权投资计划产品管理等五大投资管理能力；具备境外投资业务、组合类保险资产管理产品业务、资产支持计划产品业务、集合资金信托投资等四项投资资质；拥有中国证监会颁发的公募基金业务牌照，获选全国社会保障基金理事会养老基金管理人，是中国资本市场秉持价值投资、长期投资理念，为客户创造绝对收益的重要机构投资者。

成立二十多年来，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。

人保资产是第一家建立“委托-受托-托管”资金三方存管机制的保险资产管理机构，建立了较为完善的投研一体化平台和全面风险管理体系，不断提升资产负债匹配管理的精细化水平，坚持服务保险主业、服务国家战略。人保资产拥有一支具备国际投资视野、历经市场周期的高素质投研人才队伍，设立国家级博士后工作站。

人保资产通过实施投资赋能工程，加快推进公司高质量发展，建设服务大局、业绩突出、综合实力领先的一流综合资管公司，构建了市场化、专业化的人力资源管理机制，为青年员工提供定制化的人才培养计划、丰富的跨部门岗位历练平台以及多元化的职业发展通道，帮助员工能力成长。

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2026年6月30日，本公司旗下基金产品线逐渐丰富，涵盖了股票指数型、债券型、混合型、货币型产品，管理的基金产品分别为人保货币市场基金、人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金、人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金、人保利丰纯债债券型证券投资基金、人保安睿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、人保民享利率债债券型证券投资基金、人保泰睿积极配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保泰和积极配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、

人保红利智享混合型证券投资基金、人保中证800指数增强型证券投资基金、人保中证A500指数增强型证券投资基金、人保核心智选混合型证券投资基金、人保中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、人保均衡智选混合型证券投资基金、人保中证A50指数增强型证券投资基金、人保中证500指数增强型证券投资基金、人保上证科创板综合指数增强型证券投资基金、人保创业板综合指数增强型证券投资基金、人保中证港股通互联网指数型证券投资基金、人保睿逸智选混合型证券投资基金、人保新锐智选混合型证券投资基金、人保民鸿混合型证券投资基金、人保安悦债券型证券投资基金等。

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		
周剑	基金经理	2023-07-13	-	9.3年	华东理工大学金融学硕士，曾在中欧基金管理有限公司担任量化分析师、研究助理、研究员。2023年1月加入人保资产公募基金事业部，自2023年7月13日起任人保中证500指数型证券投资基金基金经理，2023年9月15日起担任人保沪深300指数型证券投资基金基金经理，2024年12月3日起任人保红利智享混合型证券投资基金基金经理，2025年12月16日起任人保中证500指数增强型证券投资基金基金经理，2026年3月23日起任人保中证港股通互联网指数型证券投资基金、人保睿逸智选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。

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》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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

2026年上半年，国内经济呈现弱复苏、强结构的运行特征。整体经济稳步修复，但复苏节奏不均衡，外需与产业端表现亮眼，内需恢复相对温和。高端制造、新能源、人工智能等新质生产力相关产业持续发力，出口韧性十足，成为经济增长核心支撑。不过居民消费修复偏缓慢，房地产市场持续筑底，尚未出现明显回暖态势，拖累整体内需表现。货币政策保持稳健偏宽松，市场流动性合理充裕，但宽货币向实体信用的传导效率仍有待提升。A股市场呈现典型结构性行情，整体震荡上行，科创、高端科技、AI赛道领涨市场，而消费、地产等传统板块持续承压，市场资金抱团优质成长赛道，个股与板块分化显著。

海外方面，全球经济延续分化格局。美国经济韧性超预期，通胀小幅反复，美联储暂缓降息，维持偏紧货币政策，美股在科技龙头带动下持续走高。日韩依托半导体、存

储芯片行业周期回暖，经济与资本市场表现向好。同时，地缘局势反复扰动国际大宗商品市场，油价、金价波动加剧，全球资本市场整体围绕科技成长主线运行。

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500A基金份额净值为2.2780元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为20.48%，同期业绩比较基准收益率为19.93%；截至报告期末人保中证500C基金份额净值为2.2665元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为20.25%，同期业绩比较基准收益率为19.93%。

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2026年下半年，预计国内经济延续温和复苏态势，稳增长政策持续落地显效，消费修复节奏平缓，高端制造与科创赛道保持高景气，流动性维持合理充裕，通胀运行整体温和；海外方面，美联储步入降息后半程，全球需求呈弱复苏格局，核心通胀回落仍存黏性，新兴市场资本流入边际改善。预计下半年A股市场以结构性机会为主，AI算力、先进制造等高景气成长与高股息红利资产交替占优。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所管理人在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、投研、交易、合规风控及运营等部门人员组成，以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理列席会议，但不参与具体决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种、流通受限股票等的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，中国人保资产管理有限公司在人保中证500指数型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中国人保资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关人保中证500指数型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,833,827.06	1,527,093.17

结算备付金		35,415.20	19,056.07
存出保证金		5,742.55	2,906.91
交易性金融资产	6.4.7.2	67,119,415.45	54,383,298.96
其中：股票投资		64,864,314.79	51,959,067.51
基金投资		-	-
债券投资		2,255,100.66	2,424,231.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	199,932.44
应收清算款		-	100,067.41
应收股利		-	-
应收申购款		34,099.02	169,354.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		69,028,499.28	56,401,709.83
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		20,333.51	30.39
应付赎回款		201,773.52	1,117,695.84
应付管理人报酬		24,008.52	23,837.03
应付托管费		5,335.22	5,297.13
应付销售服务费		229.62	45.71
应付投资顾问费		-	-

应交税费		2.50	12.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	47,776.90	92,961.28
负债合计		299,459.79	1,239,879.95
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	30,173,356.48	29,175,265.22
未分配利润	6.4.7.8	38,555,683.01	25,986,564.66
净资产合计		68,729,039.49	55,161,829.88
负债和净资产总计		69,028,499.28	56,401,709.83

注：报告截止日2026年06月30日，人保中证500A份额净值人民币2.2780元，基金份额总额29,731,450.15份；人保中证500C份额净值人民币2.2665元，基金份额总额441,906.33份；总份额合计30,173,356.48份。

6.2 利润表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		11,671,229.40	3,052,437.83
1.利息收入		4,996.25	4,022.50
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,097.71	1,713.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		1,898.54	2,309.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		5,958,369.49	706,883.61

其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,524,191.32	142,025.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	28,229.94	23,452.24
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	405,948.23	541,405.81
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	5,698,651.30	2,319,494.80
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	9,212.36	22,036.92
减：二、营业总支出		220,663.54	272,786.60
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	142,945.49	149,846.15
2.托管费	6.4.10.2.2	31,765.61	33,299.15
3.销售服务费	6.4.10.2.3	822.19	19.19
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		123.37	73.59
其中：卖出回购金融资产 支出		123.37	73.59
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		6.84	8.30
8.其他费用	6.4.7.19	45,000.04	89,540.22
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		11,450,565.86	2,779,651.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		11,450,565.86	2,779,651.23

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,450,565.86	2,779,651.23

6.3 净资产变动表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	29,175,265.22	25,986,564.66	55,161,829.88
二、本期期初净资产	29,175,265.22	25,986,564.66	55,161,829.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	998,091.26	12,569,118.35	13,567,209.61
（一）、综合收益总额	-	11,450,565.86	11,450,565.86
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	998,091.26	1,118,552.49	2,116,643.75
其中：1.基金申购款	8,200,181.44	8,917,476.80	17,117,658.24
2.基金赎回款	-7,202,090.18	-7,798,924.31	-15,001,014.49
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	30,173,356.48	38,555,683.01	68,729,039.49
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	57,612,697.73	26,128,016.56	83,740,714.29
二、本期期初净资产	57,612,697.73	26,128,016.56	83,740,714.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,870,762.10	-5,322,218.70	-22,192,980.80
（一）、综合收益总额	-	2,779,651.23	2,779,651.23
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-16,870,762.10	-8,101,869.93	-24,972,632.03
其中：1.基金申购款	3,214,158.28	1,432,558.86	4,646,717.14
2.基金赎回款	-20,084,920.38	-9,534,428.79	-29,619,349.17
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	40,741,935.63	20,805,797.86	61,547,733.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄明

贾鸣

沈静

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

人保中证500指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人中国人保资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《人保中证500指数型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2018]1723号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为255,386,460.94份，本基金的管理人为中国人保资产管理有限公司，托管人为交通银行股份有限公司。自2025年2月28日，本基金增设C类基金份额，并相应修改基金合同。本基金份额分为A类基金份额（以下简称“人保中证500A”），C类基金份额（以下简称“人保中证500C”）两类份额。其中，人保中证500A不收取销售服务费；人保中证500C是指按照0.40%年费率计提销售服务费的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，基金还可投资于其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括定期存款、协议存款及其他银行存款等）、货币市场工具、金融衍生工具（包括权证、股指期货、国债期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权需缴纳的现金保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况、2026年01月01日至2026年06月30日的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策

的补充通知》、财税[2016]140号文《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号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延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[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	1,833,827.06
等于：本金	1,833,654.83
加：应计利息	172.23
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	1,833,827.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		49,641,928.71	-	64,864,314.79	15,222,386.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,235,200.00	30,240.66	2,255,100.66	-10,340.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	2,235,200.00	30,240.66	2,255,100.66	-10,340.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		51,877,128.71	30,240.66	67,119,415.45	15,212,046.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无因买断式逆回购交易而取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	471.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,169.92
其中：交易所市场	3,169.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,135.04
合计	47,776.90

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 人保中证500A

金额单位：人民币元

项目 (人保中证500A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,082,559.54	29,082,559.54
本期申购	7,229,506.43	7,229,506.43
本期赎回（以“-”号填列）	-6,580,615.82	-6,580,615.82
本期末	29,731,450.15	29,731,450.15

6.4.7.7.2 人保中证500C

金额单位：人民币元

项目 (人保中证500C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92,705.68	92,705.68
本期申购	970,675.01	970,675.01
本期赎回（以“-”号填列）	-621,474.36	-621,474.36
本期末	441,906.33	441,906.33

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 人保中证500A

单位：人民币元

项目 (人保中证500A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	37,764,208.58	-11,859,674.35	25,904,534.23
本期期初	37,764,208.58	-11,859,674.35	25,904,534.23
本期利润	5,699,253.13	5,679,928.30	11,379,181.43
本期基金份额交易产生的变动数	790,169.39	-77,883.34	712,286.05

其中：基金申购款	9,540,586.24	-1,681,989.35	7,858,596.89
基金赎回款	-8,750,416.85	1,604,106.01	-7,146,310.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,253,631.10	-6,257,629.39	37,996,001.71

6.4.7.8.2 人保中证500C

单位：人民币元

项目 (人保中证500C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	59,667.83	22,362.60	82,030.43
本期期初	59,667.83	22,362.60	82,030.43
本期利润	52,661.43	18,723.00	71,384.43
本期基金份额交易产生的变动数	253,863.05	152,403.39	406,266.44
其中：基金申购款	673,299.32	385,580.59	1,058,879.91
基金赎回款	-419,436.27	-233,177.20	-652,613.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	366,192.31	193,488.99	559,681.30

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	2,997.79
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	89.97
其他	9.95
合计	3,097.71

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	14,724,645.57
减：卖出股票成本总额	9,186,871.85
减：交易费用	13,582.40
买卖股票差价收入	5,524,191.32

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	23,263.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,966.68
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	28,229.94

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,442,587.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,404,740.00
减：应计利息总额	32,880.35
减：交易费用	0.39
买卖债券差价收入	4,966.68

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	405,948.23
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	405,948.23

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	5,698,651.30
——股票投资	5,710,671.30
——债券投资	-12,020.00
——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	5,698,651.30

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	9,170.37
转换费收入	41.99
合计	9,212.36

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	4,463.46
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	865.00
合计	45,000.04

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国人保资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国人民保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东
中国人保香港资产管理有限公司	基金管理人控股子公司
人保启元惠众（北京）私募基金管理有限公司	基金管理人控股子公司
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	142,945.49	149,846.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	37,711.70	44,065.02
应支付基金管理人的净管理费	105,233.79	105,781.13

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×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 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	31,765.61	33,299.15

注：支付基金托管人交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保中证500A	人保中证500C	合计
中国人保资产管理有限公司	0.00	3.51	3.51

合计	0.00	3.51	3.51
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保中证500A	人保中证500C	合计
中国人保 资产管理 有限公司	0.00	1.19	1.19
合计	0.00	1.19	1.19

注：1、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×0.40%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：C类基金日销售服务费= C类基金份额前一日基金资产净值×0.40%÷当年天数。

2、本基金自2025年2月28日起增加C类份额。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	1,833,827.06	2,997.79	1,081,632.26	1,576.12

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026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	受限期	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
001248	华润新能源	2026-06-23	7个交易日	新股未上市	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-

注：对于在流通受限期内发生送股的股票，上表列示的数量为原受限股票数量与送股数量的加总。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在力求基金资产安全性、较高流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本基金的基金管理人建立了由董事会负最终责任、管理层直接领导、内部控制职能部门统筹协调、内部控制评价部门监察监督、业务职能部门负首要责任的分工明确、路线清晰、相互协作、有效执行的内部控制组织体系。公募基金事业部部务会为公募基金业务日常运行管理的议事机构，负责事业部经营管理重要事项的研究与决定，以及拟提交公司审批事项的审核。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，

确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金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 2026年0	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
---------------	------	------	------	-----	----

6月30日					
资产					
货币资金	1,833,827.06	-	-	-	1,833,827.06
结算备付金	35,415.20	-	-	-	35,415.20
存出保证金	5,742.55	-	-	-	5,742.55
交易性金融资产	2,255,100.66	-	-	64,864,314.79	67,119,415.45
应收申购款	-	-	-	34,099.02	34,099.02
资产总计	4,130,085.47	-	-	64,898,413.81	69,028,499.28
负债					
应付清算款	-	-	-	20,333.51	20,333.51
应付赎回款	-	-	-	201,773.52	201,773.52
应付管理人报酬	-	-	-	24,008.52	24,008.52
应付托管费	-	-	-	5,335.22	5,335.22
应付销售服务费	-	-	-	229.62	229.62
应交税费	-	-	-	2.50	2.50
其他负债	-	-	-	47,776.90	47,776.90
负债总计	-	-	-	299,459.79	299,459.79
利率敏感度缺口	4,130,085.47	-	-	64,598,954.02	68,729,039.49

上年度 末 2025年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,527,093.17	-	-	-	1,527,093.17
结算备付金	19,056.07	-	-	-	19,056.07
存出保证金	2,906.91	-	-	-	2,906.91
交易性金融资产	2,424,231.45	-	-	51,959,067.51	54,383,298.96
买入返售金融资产	199,932.44	-	-	-	199,932.44
应收清算款	-	-	-	100,067.41	100,067.41
应收申购款	-	-	-	169,354.87	169,354.87
资产总计	4,173,220.04	-	-	52,228,489.79	56,401,709.83
负债					
应付清算款	-	-	-	30.39	30.39
应付赎回款	-	-	-	1,117,695.84	1,117,695.84
应付管理人报酬	-	-	-	23,837.03	23,837.03
应付托管费	-	-	-	5,297.13	5,297.13
应付销售服务费	-	-	-	45.71	45.71

应交税费	-	-	-	12.57	12.57
其他负债	-	-	-	92,961.28	92,961.28
负债总计	-	-	-	1,239,879.95	1,239,879.95
利率敏感度缺口	4,173,220.04	-	-	50,988,609.84	55,161,829.88

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1.市场利率上升25个基点	-108.79	-1,734.82
	2.市场利率下降25个基点	109.01	1,740.31

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

截至报告期末，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 2026年06月30日		上年度末 2025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	64,864,314.79	94.38	51,959,067.51	94.19
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	64,864,314.79	94.38	51,959,067.51	94.19

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	3,429,351.31	2,843,149.21
	2.业绩比较基准下降5%	-3,429,351.31	-2,843,149.21

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	64,854,204.79	51,959,067.51
第二层次	2,265,210.66	2,424,231.45
第三层次	-	-
合计	67,119,415.45	54,383,298.96

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	64,864,314.79	93.97
	其中：股票	64,864,314.79	93.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,255,100.66	3.27
	其中：债券	2,255,100.66	3.27
	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	1,869,242.26	2.71
8	其他各项资产	39,841.57	0.06
9	合计	69,028,499.28	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	211,804.00	0.31
B	采矿业	1,991,501.84	2.90
C	制造业	48,749,397.57	70.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,574,318.40	2.29
E	建筑业	380,595.00	0.55
F	批发和零售业	1,236,648.02	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	784,167.00	1.14

H	住宿和餐饮业	46,774.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,151,627.32	6.04
J	金融业	3,421,183.50	4.98
K	房地产业	260,263.00	0.38
L	租赁和商务服务业	662,071.80	0.96
M	科学研究和技术服务业	463,437.00	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	223,588.18	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	150,236.56	0.22
R	文化、体育和娱乐业	302,927.60	0.44
S	综合	-	-
	合计	64,610,540.79	94.01

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	213,559.00	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,110.00	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,201.00	0.02
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	14,904.00	0.02
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	253,774.00	0.37

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688498	源杰科技	600	1,131,600.00	1.65
2	300604	长川科技	2,500	853,550.00	1.24
3	001309	德明利	900	848,610.00	1.23
4	688347	华虹宏力	2,400	807,120.00	1.17
5	688120	华海清科	2,198	708,151.64	1.03
6	002008	大族激光	4,700	705,517.00	1.03
7	002281	光迅科技	2,700	693,738.00	1.01
8	300136	信维通信	5,700	679,725.00	0.99
9	300857	协创数据	1,960	666,204.00	0.97
10	688361	中科飞测	1,400	602,000.00	0.88

11	300475	香农芯创	1,900	570,000.00	0.83
12	300223	北京君正	2,200	547,580.00	0.80
13	002436	兴森科技	9,700	494,215.00	0.72
14	300285	国瓷材料	4,500	464,310.00	0.68
15	300054	鼎龙股份	4,300	455,671.00	0.66
16	600105	永鼎股份	6,600	445,368.00	0.65
17	300666	江丰电子	1,200	442,320.00	0.64
18	688037	芯源微	1,000	439,050.00	0.64
19	300757	罗博特科	700	433,300.00	0.63
20	688777	中控技术	3,600	423,000.00	0.62
21	688200	华峰测控	800	420,080.00	0.61
22	000021	深科技	6,400	411,328.00	0.60
23	300548	长芯博创	1,400	389,200.00	0.57
24	002851	麦格米特	2,300	384,514.00	0.56
25	601869	长飞光纤	700	382,130.00	0.56
26	300346	南大光电	3,900	361,335.00	0.53
27	002409	雅克科技	1,600	359,200.00	0.52
28	300567	精测电子	1,100	349,360.00	0.51
29	002407	多氟多	6,800	341,564.00	0.50
30	300620	光库科技	900	340,380.00	0.50
31	002185	华天科技	15,200	339,112.00	0.49
32	600498	烽火通信	4,600	338,560.00	0.49
33	002138	顺络电子	4,600	336,260.00	0.49
34	688017	绿的谐波	800	334,288.00	0.49
35	688019	安集科技	980	332,670.80	0.48
36	688313	仕佳光子	1,800	332,370.00	0.48
37	688002	睿创微纳	2,100	324,849.00	0.47
38	600879	航天电子	15,100	321,479.00	0.47
39	300395	菲利华	2,400	320,952.00	0.47
40	300390	天华新能	3,320	310,453.20	0.45
41	688469	芯联集成	28,800	305,568.00	0.44

42	301526	国际复材	6,500	303,355.00	0.44
43	002273	水晶光电	7,998	283,769.04	0.41
44	300058	蓝色光标	20,580	283,180.80	0.41
45	300373	扬杰科技	1,800	283,014.00	0.41
46	300037	新宙邦	3,000	278,550.00	0.41
47	301377	鼎泰高科	500	275,450.00	0.40
48	688172	燕东微	3,200	267,712.00	0.39
49	603256	宏和科技	1,000	265,330.00	0.39
50	605358	立昂微	3,400	263,840.00	0.38
51	300751	迈为股份	900	254,214.00	0.37
52	600988	赤峰黄金	9,500	250,040.00	0.36
53	688099	晶晨股份	2,400	246,960.00	0.36
54	002738	中矿资源	4,160	245,398.40	0.36
55	002126	银轮股份	4,900	244,020.00	0.36
56	600885	宏发股份	7,068	243,775.32	0.35
57	000960	锡业股份	5,700	243,333.00	0.35
58	605589	圣泉集团	3,800	241,566.00	0.35
59	000831	中国稀土	4,300	238,607.00	0.35
60	600392	盛和资源	8,000	238,160.00	0.35
61	600601	方正科技	17,200	238,048.00	0.35
62	001389	广合科技	1,000	237,250.00	0.35
63	688702	盛科通信	600	233,994.00	0.34
64	603129	春风动力	900	230,220.00	0.33
65	002812	恩捷股份	3,400	227,494.00	0.33
66	600378	昊华科技	3,000	226,140.00	0.33
67	688234	天岳先进	1,300	225,563.00	0.33
68	600141	兴发集团	4,800	225,456.00	0.33
69	300570	太辰光	900	222,039.00	0.32
70	301358	湖南裕能	2,900	220,023.00	0.32
71	601179	中国西电	14,700	219,324.00	0.32
72	688052	纳芯微	746	215,079.26	0.31

73	002195	岩山科技	32,550	212,877.00	0.31
74	600497	驰宏锌锗	17,300	209,503.00	0.30
75	002850	科达利	1,100	208,230.00	0.30
76	002261	拓维信息	7,200	201,672.00	0.29
77	688027	国盾量子	400	201,604.00	0.29
78	600157	永泰能源	125,100	201,411.00	0.29
79	003031	中瓷电子	1,080	194,724.00	0.28
80	600711	盛屯矿业	17,700	194,169.00	0.28
81	002340	格林美	29,300	193,673.00	0.28
82	600909	华安证券	17,320	192,425.20	0.28
83	600143	金发科技	12,300	190,035.00	0.28
84	688629	华丰科技	1,000	187,510.00	0.27
85	300017	网宿科技	14,300	186,043.00	0.27
86	000783	长江证券	19,000	185,250.00	0.27
87	002131	利欧股份	38,800	184,300.00	0.27
88	002203	海亮股份	7,907	180,674.95	0.26
89	600352	浙江龙盛	14,900	180,439.00	0.26
90	301200	大族数控	500	180,325.00	0.26
91	601555	东吴证券	22,760	180,259.20	0.26
92	301611	珂玛科技	1,000	180,070.00	0.26
93	002966	苏州银行	25,610	178,245.60	0.26
94	002821	凯莱英	1,100	178,200.00	0.26
95	601233	桐昆股份	8,200	177,530.00	0.26
96	300339	润和软件	4,600	177,146.00	0.26
97	603659	璞泰来	6,100	176,473.00	0.26
98	688220	翱捷科技	1,411	175,415.52	0.26
99	688578	艾力斯	1,600	174,720.00	0.25
99	688411	海博思创	600	174,720.00	0.25
100	688213	思特威	1,600	171,312.00	0.25
101	300759	康龙化成	5,900	170,687.00	0.25
102	688122	西部超导	2,610	163,934.10	0.24

103	603308	应流股份	2,700	163,080.00	0.24
104	002472	双环传动	3,900	161,889.00	0.24
105	300207	欣旺达	8,500	161,415.00	0.23
106	601108	财通证券	18,600	160,890.00	0.23
107	002517	恺英网络	9,800	159,250.00	0.23
108	300001	特锐德	4,200	158,886.00	0.23
109	002797	第一创业	24,100	158,337.00	0.23
110	002601	龙佰集团	9,600	158,208.00	0.23
111	601958	金钼股份	5,600	157,416.00	0.23
112	300458	全志科技	3,980	157,050.80	0.23
113	688385	复旦微电	2,200	156,838.00	0.23
114	688322	奥比中光	1,200	156,660.00	0.23
115	300115	长盈精密	5,600	156,464.00	0.23
116	688387	信科移动	7,800	154,752.00	0.23
117	688235	百济神州	600	152,766.00	0.22
118	600563	法拉电子	800	152,640.00	0.22
119	601198	东兴证券	11,100	150,849.00	0.22
120	601991	大唐发电	21,300	150,804.00	0.22
121	000703	恒逸石化	11,000	149,270.00	0.22
122	002155	湖南黄金	6,242	148,996.54	0.22
123	002465	海格通信	11,400	145,578.00	0.21
124	300454	深信服	1,500	144,300.00	0.21
125	603179	新泉股份	2,900	143,985.00	0.21
126	002056	横店东磁	4,700	143,256.00	0.21
127	601665	齐鲁银行	24,700	142,519.00	0.21
128	603156	养元饮品	2,900	142,303.00	0.21
129	002402	和而泰	5,500	142,065.00	0.21
130	600884	杉杉股份	10,300	139,565.00	0.20
131	300024	机器人	7,200	139,176.00	0.20
132	600707	彩虹股份	8,200	138,498.00	0.20
133	603650	彤程新材	1,400	137,172.00	0.20

134	688301	奕瑞科技	1,106	137,144.00	0.20
135	002130	沃尔核材	7,200	136,512.00	0.20
136	601162	天风证券	40,400	136,148.00	0.20
137	688676	金盘科技	1,600	135,424.00	0.20
138	002429	兆驰股份	13,000	135,070.00	0.20
139	000060	中金岭南	17,800	134,746.00	0.20
140	300012	华测检测	9,600	133,056.00	0.19
141	000878	云南铜业	8,309	131,946.92	0.19
142	601099	太平洋	39,100	131,767.00	0.19
143	000893	亚钾国际	3,200	130,848.00	0.19
144	600109	国金证券	14,900	130,822.00	0.19
145	002271	东方雨虹	11,000	130,570.00	0.19
146	603379	三美股份	1,720	130,530.80	0.19
147	300623	捷捷微电	2,900	130,471.00	0.19
148	688331	荣昌生物	1,000	130,260.00	0.19
149	002414	高德红外	9,800	129,948.00	0.19
150	000034	神州数码	4,680	129,870.00	0.19
151	300496	中科创达	2,100	129,759.00	0.19
152	002335	科华数据	3,045	129,260.25	0.19
153	301536	星宸科技	1,000	128,710.00	0.19
154	603688	石英股份	1,550	128,045.50	0.19
155	002487	大金重工	2,200	127,534.00	0.19
156	002444	巨星科技	4,100	127,510.00	0.19
157	002432	九安医疗	1,800	127,224.00	0.19
158	600256	广汇能源	25,700	126,958.00	0.18
159	600298	安琪酵母	3,500	126,700.00	0.18
160	000661	长春高新	1,900	126,540.00	0.18
161	300763	锦浪科技	1,400	126,490.00	0.18
162	600060	海信视像	4,500	125,415.00	0.18
163	002756	永兴材料	2,200	124,608.00	0.18
163	000733	振华科技	2,200	124,608.00	0.18

164	688728	格科微	5,900	124,136.00	0.18
165	300474	景嘉微	2,050	123,984.00	0.18
166	603979	金诚信	2,100	123,963.00	0.18
167	603766	隆鑫通用	10,300	122,879.00	0.18
168	600021	上海电力	8,100	122,067.00	0.18
169	600699	均胜电子	5,640	121,880.40	0.18
170	300748	金力永磁	3,940	121,549.00	0.18
171	601696	中银证券	9,600	121,440.00	0.18
172	601615	明阳智能	10,400	120,328.00	0.18
173	601577	长沙银行	13,800	120,198.00	0.17
174	603920	世运电路	2,500	120,100.00	0.17
174	300073	当升科技	2,500	120,100.00	0.17
175	002078	太阳纸业	9,600	119,904.00	0.17
176	300142	沃森生物	9,200	119,508.00	0.17
177	603087	甘李药业	2,100	119,196.00	0.17
178	002157	正邦科技	42,400	119,144.00	0.17
179	603606	东方电缆	2,860	118,718.60	0.17
180	300432	富临精工	5,900	118,531.00	0.17
181	300919	中伟新材	2,700	118,125.00	0.17
182	000423	东阿阿胶	2,600	117,936.00	0.17
183	688266	泽璟制药	1,000	116,660.00	0.17
184	002252	上海莱士	26,500	115,010.00	0.17
185	002025	航天电器	1,500	114,330.00	0.17
186	688343	云天励飞	1,400	114,324.00	0.17
187	688375	国博电子	1,094	114,104.20	0.17
188	688169	石头科技	1,200	113,964.00	0.17
189	688599	天合光能	8,000	112,960.00	0.16
189	300724	捷佳伟创	1,600	112,960.00	0.16
190	000728	国元证券	15,000	112,350.00	0.16
191	002064	华峰化学	11,400	108,186.00	0.16
192	603290	斯达半导	700	107,058.00	0.16

193	688608	恒玄科技	640	107,001.60	0.16
194	300953	震裕科技	800	106,960.00	0.16
195	000786	北新建材	5,900	106,731.00	0.16
196	603119	浙江荣泰	1,600	106,144.00	0.15
197	600171	上海贝岭	3,300	105,402.00	0.15
198	001203	大中矿业	3,500	104,825.00	0.15
199	002831	裕同科技	2,929	104,155.24	0.15
200	300972	万辰集团	600	104,046.00	0.15
201	300383	光环新网	8,200	102,008.00	0.15
202	300679	电连技术	1,700	101,983.00	0.15
203	300677	英科医疗	2,600	101,842.00	0.15
204	688180	君实生物	3,000	101,460.00	0.15
205	000519	中兵红箭	4,800	101,136.00	0.15
206	603806	福斯特	6,000	100,740.00	0.15
207	600177	雅戈尔	13,300	100,149.00	0.15
208	600516	方大炭素	16,200	99,954.00	0.15
209	002673	西部证券	15,400	99,946.00	0.15
210	688568	中科星图	2,400	99,528.00	0.14
211	603160	汇顶科技	1,600	98,736.00	0.14
212	601699	潞安环能	6,900	98,532.00	0.14
213	000559	万向钱潮	7,583	98,048.19	0.14
214	000623	吉林敖东	5,518	97,834.14	0.14
215	600642	申能股份	11,200	97,776.00	0.14
216	688692	达梦数据	400	97,716.00	0.14
217	002624	完美世界	7,800	96,876.00	0.14
218	600637	东方明珠	11,600	96,396.00	0.14
219	603345	安井食品	1,200	96,228.00	0.14
220	688187	时代电气	1,400	96,124.00	0.14
221	001696	宗申动力	4,600	95,726.00	0.14
222	688065	凯赛生物	2,000	95,700.00	0.14
223	300699	光威复材	3,320	95,118.00	0.14

224	603225	新凤鸣	4,820	94,713.00	0.14
225	000983	山西焦煤	16,300	94,540.00	0.14
226	002085	万丰奥威	8,500	94,265.00	0.14
227	000750	国海证券	25,600	94,208.00	0.14
228	688188	柏楚电子	881	94,002.70	0.14
229	002318	久立特材	3,900	93,210.00	0.14
230	002739	儒意电影	9,700	93,120.00	0.14
231	688018	乐鑫科技	727	92,997.84	0.14
232	600100	同方股份	13,500	92,475.00	0.13
233	002065	东华软件	12,900	92,106.00	0.13
234	600369	西南证券	22,900	92,058.00	0.13
235	600536	中国软件	3,261	91,699.32	0.13
236	300558	贝达药业	1,400	91,098.00	0.13
237	600499	科达制造	6,600	91,080.00	0.13
237	002266	浙富控股	18,000	91,080.00	0.13
238	603699	纽威股份	1,800	90,540.00	0.13
238	002044	美年健康	18,000	90,540.00	0.13
239	600595	中孚实业	16,100	90,482.00	0.13
240	603596	伯特利	3,641	90,442.44	0.13
241	688772	珠海冠宇	4,602	90,337.26	0.13
242	300627	华测导航	3,140	89,176.00	0.13
243	000400	许继电气	4,100	88,970.00	0.13
244	000629	钒钛股份	26,600	88,844.00	0.13
245	000155	川能动力	7,400	88,652.00	0.13
246	002223	鱼跃医疗	3,450	88,527.00	0.13
247	300002	神州泰岳	11,300	88,253.00	0.13
248	300003	乐普医疗	7,400	87,690.00	0.13
249	688617	惠泰医疗	482	87,511.92	0.13
250	000032	深桑达 A	3,500	87,325.00	0.13
251	601016	节能风电	22,500	87,300.00	0.13
252	600985	淮北矿业	6,200	87,110.00	0.13

253	000415	渤海租赁	21,300	86,691.00	0.13
254	002430	杭氧股份	2,800	86,688.00	0.13
255	600862	中航高科	4,800	86,544.00	0.13
256	601216	君正集团	19,400	86,524.00	0.13
257	600521	华海药业	6,000	86,400.00	0.13
258	601212	白银有色	17,000	86,360.00	0.13
259	002841	视源股份	2,500	86,325.00	0.13
260	601717	中创智领	6,200	86,242.00	0.13
261	601997	贵阳银行	16,800	86,184.00	0.13
262	688615	合合信息	760	85,956.00	0.13
263	000683	博源化工	14,900	85,824.00	0.12
264	000039	中集集团	10,520	85,317.20	0.12
265	600863	华能蒙电	18,000	84,600.00	0.12
266	600704	物产中大	17,800	84,016.00	0.12
267	603605	珀莱雅	1,400	83,888.00	0.12
268	601001	晋控煤业	4,800	83,472.00	0.12
269	000050	深天马 A	8,400	83,244.00	0.12
270	600873	梅花生物	11,300	83,055.00	0.12
271	600312	平高电气	4,700	83,002.00	0.12
272	601990	南京证券	12,600	82,782.00	0.12
273	300487	蓝晓科技	1,400	82,390.00	0.12
274	603077	和邦生物	35,500	82,360.00	0.12
275	688538	和辉光电	31,676	82,357.60	0.12
276	000729	燕京啤酒	8,100	82,053.00	0.12
277	000887	中鼎股份	4,570	81,757.30	0.12
278	600765	中航重机	6,280	81,137.60	0.12
279	000967	盈峰环境	7,700	81,081.00	0.12
280	600332	白云山	4,000	80,160.00	0.12
281	688297	中无人机	1,927	80,066.85	0.12
282	600166	福田汽车	27,300	79,443.00	0.12
283	600153	建发股份	10,000	79,300.00	0.12

284	000830	鲁西化工	6,600	79,200.00	0.12
285	600348	华阳股份	10,350	79,177.50	0.12
286	688582	芯动联科	1,200	78,000.00	0.11
287	002939	长城证券	9,300	77,562.00	0.11
288	002410	广联达	9,500	77,520.00	0.11
289	601611	中国核建	6,900	76,935.00	0.11
290	002007	华兰生物	6,300	76,797.00	0.11
291	600901	江苏金租	13,320	76,590.00	0.11
292	000062	深圳华强	2,400	76,368.00	0.11
293	002683	广东宏大	2,600	76,154.00	0.11
294	600737	中粮糖业	6,100	75,213.00	0.11
295	600578	京能电力	11,500	74,175.00	0.11
296	000921	海信家电	2,700	73,764.00	0.11
297	002926	华西证券	9,000	73,530.00	0.11
298	603728	鸣志电器	1,200	73,104.00	0.11
299	000737	北方铜业	5,500	72,710.00	0.11
300	600486	扬农化工	1,430	72,501.00	0.11
301	601799	星宇股份	800	72,496.00	0.11
302	603568	伟明环保	4,711	72,455.18	0.11
303	603341	龙旗科技	1,700	72,233.00	0.11
304	000591	太阳能	15,700	72,220.00	0.11
305	600398	海澜之家	13,800	72,174.00	0.11
306	002603	以岭药业	4,800	72,000.00	0.10
307	603444	吉比特	200	71,684.00	0.10
308	603298	杭叉集团	3,000	71,580.00	0.10
309	601000	唐山港	17,000	70,550.00	0.10
310	000528	柳工	9,300	70,215.00	0.10
311	600316	洪都航空	2,500	69,850.00	0.10
312	000738	航发控制	3,800	69,502.00	0.10
313	600208	衢州发展	24,400	69,052.00	0.10
314	600008	首创环保	25,300	68,816.00	0.10

315	600435	北方导航	6,102	68,342.40	0.10
316	000932	华菱钢铁	19,680	68,289.60	0.10
317	600170	上海建工	30,600	67,932.00	0.10
318	600998	九州通	14,474	67,883.06	0.10
319	688114	华大智造	1,328	67,834.24	0.10
320	600995	南网储能	5,500	67,650.00	0.10
321	000987	越秀资本	8,585	67,134.70	0.10
322	002152	广电运通	7,100	66,598.00	0.10
323	000951	中国重汽	3,400	66,334.00	0.10
324	000997	新大陆	4,050	66,015.00	0.10
325	600161	天坛生物	5,700	66,006.00	0.10
326	603486	科沃斯	1,300	65,975.00	0.10
327	600820	隧道股份	12,600	65,646.00	0.10
328	002262	恩华药业	3,500	65,625.00	0.10
329	600483	福能股份	6,400	65,216.00	0.09
330	601106	中国一重	19,700	65,010.00	0.09
331	603885	吉祥航空	6,300	64,827.00	0.09
332	000009	中国宝安	10,400	64,792.00	0.09
333	600282	南钢股份	14,100	64,719.00	0.09
334	600583	海油工程	12,700	63,881.00	0.09
335	603338	浙江鼎力	1,500	63,750.00	0.09
336	002500	山西证券	12,300	63,468.00	0.09
337	688778	厦钨新能	1,160	63,104.00	0.09
338	688166	博瑞医药	1,800	63,018.00	0.09
339	603816	顾家家居	2,800	62,608.00	0.09
340	600546	山煤国际	5,700	62,301.00	0.09
341	688248	南网科技	900	62,262.00	0.09
342	000582	北部湾港	5,800	62,234.00	0.09
343	603939	益丰药房	3,452	62,066.96	0.09
344	600685	中船防务	2,400	61,056.00	0.09
345	601666	平煤股份	8,500	60,775.00	0.09

346	600038	中直股份	2,400	60,696.00	0.09
347	688295	中复神鹰	1,000	60,540.00	0.09
348	601567	三星电气	4,000	59,760.00	0.09
349	600763	通策医疗	1,762	59,696.56	0.09
350	002312	川发龙蟒	6,500	59,605.00	0.09
351	300676	华大基因	1,700	59,602.00	0.09
352	003022	联泓新科	2,300	59,570.00	0.09
353	600329	达仁堂	1,600	59,552.00	0.09
354	600602	云赛智联	3,700	59,496.00	0.09
355	600562	国睿科技	2,800	59,416.00	0.09
356	600380	健康元	6,300	59,346.00	0.09
357	000723	美锦能源	17,700	59,295.00	0.09
358	603565	中谷物流	6,000	58,860.00	0.09
359	600390	五矿资本	12,900	58,824.00	0.09
360	601880	辽港股份	42,200	58,236.00	0.08
361	601156	东航物流	3,600	58,032.00	0.08
362	600132	重庆啤酒	1,400	57,820.00	0.08
363	601865	福莱特	5,500	57,805.00	0.08
364	000513	丽珠集团	2,000	57,780.00	0.08
365	601399	国机重装	16,500	57,750.00	0.08
366	600511	国药股份	2,200	57,288.00	0.08
367	600535	天士力	4,300	56,889.00	0.08
368	300100	双林股份	2,000	55,560.00	0.08
369	600977	中国电影	4,300	55,556.00	0.08
370	600906	财达证券	7,430	55,427.80	0.08
371	601236	红塔证券	8,100	55,242.00	0.08
372	000598	兴蓉环境	8,600	55,212.00	0.08
373	600816	建元信托	22,600	55,144.00	0.08
374	000739	普洛药业	3,300	54,978.00	0.08
375	300718	长盛轴承	900	54,873.00	0.08
376	300735	光弘科技	2,400	54,576.00	0.08

376	002299	圣农发展	3,600	54,576.00	0.08
377	688278	特宝生物	1,000	54,400.00	0.08
378	688318	财富趋势	760	54,195.60	0.08
379	002244	滨江集团	7,100	53,960.00	0.08
380	688281	华秦科技	1,068	53,645.64	0.08
381	600970	中材国际	7,500	53,475.00	0.08
382	601155	新城控股	5,200	53,352.00	0.08
383	600967	内蒙一机	4,900	53,165.00	0.08
384	002120	韵达股份	8,300	52,788.00	0.08
385	000883	湖北能源	12,200	52,704.00	0.08
386	300146	汤臣倍健	5,800	52,432.00	0.08
387	003021	兆威机电	600	52,410.00	0.08
388	300144	宋城演艺	9,000	52,290.00	0.08
389	688336	三生国健	960	50,976.00	0.07
390	000027	深圳能源	8,220	50,964.00	0.07
391	002568	百润股份	3,000	50,760.00	0.07
392	000800	一汽解放	8,500	50,575.00	0.07
393	688363	华熙生物	1,400	50,078.00	0.07
394	601608	中信重工	10,483	50,003.91	0.07
395	603737	三棵树	2,069	49,862.90	0.07
396	600095	湘财股份	6,600	49,698.00	0.07
397	600131	国网信通	3,400	49,640.00	0.07
398	601866	中远海发	22,400	49,504.00	0.07
399	000088	盐田港	11,900	48,671.00	0.07
400	002583	海能达	6,300	48,447.00	0.07
401	600801	华新建材	3,100	48,360.00	0.07
402	601118	海南橡胶	9,800	48,216.00	0.07
403	603000	人民网	3,200	47,328.00	0.07
404	600871	石化油服	23,300	47,299.00	0.07
405	600126	杭钢股份	7,700	47,201.00	0.07
406	002984	森麒麟	3,600	47,052.00	0.07

407	600754	锦江酒店	2,600	46,774.00	0.07
408	600566	济川药业	2,100	46,599.00	0.07
409	600655	豫园股份	11,200	46,032.00	0.07
410	000709	河钢股份	23,700	45,978.00	0.07
411	600517	国网英大	9,800	45,864.00	0.07
412	603589	口子窖	2,400	44,832.00	0.07
413	000825	太钢不锈	13,100	44,671.00	0.06
414	600598	北大荒	4,100	44,444.00	0.06
415	601598	中国外运	8,900	44,144.00	0.06
416	603858	步长制药	3,000	43,800.00	0.06
417	002423	中粮资本	5,300	43,619.00	0.06
418	001286	陕西能源	4,300	43,602.00	0.06
419	600350	山东高速	3,900	43,407.00	0.06
420	603899	晨光股份	2,100	43,323.00	0.06
421	002773	康弘药业	2,100	42,945.00	0.06
422	603529	爱玛科技	2,200	42,922.00	0.06
423	600004	白云机场	5,900	42,834.00	0.06
424	601966	玲珑轮胎	4,200	42,798.00	0.06
425	688349	三一重能	2,818	42,777.24	0.06
426	301606	绿联科技	700	42,714.00	0.06
427	600663	陆家嘴	6,800	42,704.00	0.06
428	600582	天地科技	9,500	42,275.00	0.06
429	600848	上海临港	5,500	41,195.00	0.06
430	688563	航材股份	800	40,984.00	0.06
431	000429	粤高速 A	3,000	40,950.00	0.06
432	601098	中南传媒	4,090	40,245.60	0.06
433	688192	迪哲医药	1,000	39,930.00	0.06
434	002508	老板电器	2,700	39,474.00	0.06
435	603233	大参林	2,600	39,078.00	0.06
436	600968	海油发展	11,700	38,961.00	0.06
437	601928	凤凰传媒	4,400	38,676.00	0.06

438	688561	奇安信	1,600	38,368.00	0.06
439	688709	成都华微	1,000	38,090.00	0.06
440	600062	华润双鹤	2,360	37,854.40	0.06
441	003035	南网能源	6,500	37,830.00	0.06
442	300957	贝泰妮	1,200	37,812.00	0.06
443	688425	铁建重工	9,200	36,984.00	0.05
444	300888	稳健医疗	1,320	36,946.80	0.05
445	600688	上海石化	12,600	36,918.00	0.05
446	601808	中海油服	3,400	36,754.00	0.05
447	600295	鄂尔多斯	3,400	36,448.00	0.05
448	002670	国盛证券	3,300	36,300.00	0.05
449	002032	苏泊尔	900	35,640.00	0.05
450	600098	广州发展	6,000	35,460.00	0.05
451	000539	粤电力A	5,100	34,731.00	0.05
452	000537	绿发电力	4,740	34,649.40	0.05
453	600808	马钢股份	13,700	34,250.00	0.05
454	002153	石基信息	4,720	34,125.60	0.05
455	600292	电投水电	2,800	33,712.00	0.05
456	600377	宁沪高速	2,800	32,396.00	0.05
457	601298	青岛港	4,000	32,200.00	0.05
458	002265	建设工业	1,800	31,320.00	0.05
459	000959	首钢股份	8,900	31,239.00	0.05
460	688708	佳驰科技	600	30,480.00	0.04
461	301301	川宁生物	3,800	30,172.00	0.04
462	603833	欧派家居	1,000	30,110.00	0.04
463	002608	江苏国信	4,300	29,670.00	0.04
464	600339	中油工程	9,600	29,472.00	0.04
465	600606	绿地控股	24,200	29,282.00	0.04
466	603658	安图生物	1,000	29,020.00	0.04
467	600032	浙江新能	4,100	28,905.00	0.04
468	603786	科博达	700	28,637.00	0.04

469	000785	居然智家	14,300	28,600.00	0.04
470	688520	神州细胞	831	28,428.51	0.04
471	301498	乖宝宠物	700	28,413.00	0.04
472	600764	中国海防	1,600	27,888.00	0.04
473	601139	深圳燃气	4,900	27,734.00	0.04
474	603049	中策橡胶	600	26,886.00	0.04
475	603175	超颖电子	300	26,727.00	0.04
476	000937	冀中能源	6,710	26,705.80	0.04
477	300140	节能环保	5,300	26,341.00	0.04
478	000898	鞍钢股份	13,700	25,619.00	0.04
479	601228	广州港	8,700	24,534.00	0.04
480	688475	萤石网络	853	23,329.55	0.03
481	601019	山东出版	3,600	23,040.00	0.03
482	600927	永安期货	1,700	21,165.00	0.03
483	002945	华林证券	1,500	20,145.00	0.03
484	601112	振石股份	1,100	20,053.00	0.03
485	002461	珠江啤酒	2,500	18,925.00	0.03
486	688819	天能股份	848	18,825.60	0.03
487	600299	安迪苏	2,300	18,055.00	0.03
488	603092	德力佳	200	10,794.00	0.02
489	001386	马可波罗	600	8,496.00	0.01
490	001221	悍高集团	200	8,044.00	0.01

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	301383	天键股份	700	16,730.00	0.02
2	301187	欧圣电气	1,100	15,741.00	0.02
3	603900	莱绅通灵	2,700	15,201.00	0.02

4	688084	晶品特装	300	15,084.00	0.02
5	688225	亚信安全	1,200	14,904.00	0.02
6	688357	建龙微纳	500	14,735.00	0.02
7	688085	三友医疗	1,200	14,364.00	0.02
8	301068	大地海洋	600	14,280.00	0.02
9	301063	海锅股份	800	13,408.00	0.02
10	603151	邦基科技	1,200	13,188.00	0.02
11	603801	志邦家居	2,400	13,032.00	0.02
12	600731	湖南海利	2,500	12,800.00	0.02
13	001255	博菲电气	500	12,545.00	0.02
14	688015	交控科技	800	12,304.00	0.02
15	300837	浙矿股份	500	11,880.00	0.02
16	300942	易瑞生物	2,000	11,560.00	0.02
17	603238	诺邦股份	1,000	11,000.00	0.02
18	301229	纽泰格	900	10,908.00	0.02
19	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.01
20	000540	*ST中天	27,500	-	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688498	源杰科技	856,606.00	1.55
2	001309	德明利	569,624.00	1.03
3	300475	香农芯创	358,750.00	0.65
4	600105	永鼎股份	347,118.00	0.63
5	300666	江丰电子	330,325.00	0.60
6	300548	长芯博创	317,167.00	0.57
7	601869	长飞光纤	306,486.00	0.56

8	688313	仕佳光子	270,429.33	0.49
9	002407	多氟多	263,936.00	0.48
10	300620	光库科技	260,274.89	0.47
11	688200	华峰测控	241,400.00	0.44
12	301377	鼎泰高科	237,648.00	0.43
13	600711	盛屯矿业	230,345.00	0.42
14	002812	恩捷股份	229,503.00	0.42
15	603256	宏和科技	211,217.00	0.38
16	688037	芯源微	188,198.00	0.34
17	301526	国际复材	187,422.00	0.34
18	600256	广汇能源	167,764.00	0.30
19	603308	应流股份	162,763.00	0.30
20	688411	海博思创	157,982.00	0.29

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	600487	亨通光电	1,136,201.00	2.06
2	688525	佰维存储	708,076.00	1.28
3	002353	杰瑞股份	537,882.00	0.98
4	301308	江波龙	526,327.00	0.95
5	600549	厦门钨业	435,033.00	0.79
6	000657	中钨高新	434,390.00	0.79
7	002156	通富微电	421,953.00	0.76
8	002837	英维克	326,908.00	0.59
9	000426	兴业银锡	324,286.00	0.59
10	002202	金风科技	319,476.00	0.58
11	601168	西部矿业	309,340.00	0.56

12	600673	东阳光	288,116.00	0.52
13	600118	中国卫星	287,018.00	0.52
14	300450	先导智能	281,945.00	0.51
15	000933	神火股份	261,663.00	0.47
16	002080	中材科技	256,797.00	0.47
17	600580	卧龙电驱	231,636.80	0.42
18	600096	云天化	230,043.00	0.42
19	002532	天山铝业	228,731.00	0.41
20	603228	景旺电子	219,638.82	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	16,381,447.83
卖出股票收入（成交）总额	14,724,645.57

注：本项"买入股票成本"、"卖出股票收入"按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,255,100.66	3.28
	其中：政策性金融债	2,255,100.66	3.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,255,100.66	3.28

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	018012	国开2003	22,000	2,255,100.66	3.28

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

国开2003（代码：018012）为本基金前十大持仓证券。2025年7月25日，据国家外汇管理局北京市分局发布的行政处罚信息显示，国家开发银行因违规办理内保外贷业务，违反规定办理结汇、售汇业务，未按照规定进行国际收支统计申报，国家外汇管理局北京市分局给予警告，没收违法所得，罚款13944200元。2025年9月22日，据中国人民银行发布的行政处罚信息显示，国家开发银行因违反金融统计相关规定，中国人民银行给予警告，处以罚款123万元。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	5,742.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,099.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,841.57

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有	户均持有的 基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人 户 数 (户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
人保 中证5 00A	3,1 82	9,343.64	14,305,354.63	48.1 2%	15,426,095.52	51.88%
人保 中证5 00C	295	1,497.99	0.00	0.00%	441,906.33	100.00%
合计	3,4 68	8,700.51	14,305,354.63	47.4 1%	15,868,001.85	52.59%

注：1、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）。

2、若同一持有人同时持有多个类别基金份额，将会合并计算，所以会存在持有人户数合计数小于各份额类别持有人户数总和的情形。

8.2 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	人保中证500 A	68,933.39	0.23%
	人保中证500 C	674.49	0.15%
	合计	69,607.88	0.23%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	人保中证500A	0~10
	人保中证500C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基	人保中证500A	0

金	人保中证500C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	人保中证500A	人保中证500C
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	29,082,559.54	92,705.68
本报告期基金总申购份额	7,229,506.43	970,675.01
减：本报告期基金总赎回份额	6,580,615.82	621,474.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,731,450.15	441,906.33

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

2026年3月28日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，新任公司公募基金事业部副总经理王小虎、公司公募基金事业部副总经理靳戈、公司公募基金事业部总经理助理及公募基金财务负责人沈静、公司公募基金首席信息官朱佑翰。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
长江证券	1	4,265,276.39	13.72%	579.67	13.72%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	1,792,414.00	5.76%	243.57	5.76%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

招商 证券	1	13,814,121.39	44.42%	1,877.51	44.42%	-
中信 建投	1	-	-	-	-	-
中信 证券	1	11,224,171.62	36.10%	1,525.59	36.10%	-
长城 证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下：

(1)基本情况：包括但不限于资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；主要股东实力强大；具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合进行证券交易的需要，并能为投资组合提供全面的信息服务；

(2)公司治理：公司治理完善，股东会、董事会、监事会及管理层权责明确，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；

(3)研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能在符合相关法规及执业规范的前提下，根据公司的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强风险意识和风险测算能力；

2、基金交易单元的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无新增或退租交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	-	-	23,350,000.00	68.37%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

海通证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证 券	3,208.92	0.14%	1,600,000.00	4.69%	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券	2,241,698.5 0	99.86%	9,200,000.00	26.94%	-	-	-	-
长城证 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	公司旗下基金2025年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-21
2	人保中证500指数型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-21
3	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-28
4	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	2026-03-14
5	人保中证500指数型证券投资基金招募说明书更新（2026年第1号）	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-14
6	人保中证500指数型证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-14
7	中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-28
8	公司旗下基金2025年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
9	人保中证500指数型证券投	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30

	资基金2025年年度报告		
10	中国人保资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-31
11	中国人保资产管理有限公司关于调整旗下部分基金风险评级相关事项的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-17
12	公司旗下基金2026年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-21
13	人保中证500指数型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-21
14	中国人保资产管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回份额和最低持有限额的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-06
15	2025年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-08
16	关于暂停网上交易系统服务的通知	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-12

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260630	14,305,354.63	-	-	14,305,354.63	47.41%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。							

当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

基金托管人地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

二〇二六年八月二十九日