

人保中证 500 指数型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:2023 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62

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.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§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	26,176,445.24份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

信息披露 负责人	姓名	郭乐琦	陆志俊
	联系电话	021-38572076	95559
	电子邮箱	guolq@piccamc.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-820-7999	95559
传真		021-50765598	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道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		北京市西城区西长安街88号 中国人保大厦9层	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		100031	200336
法定代表人		曾北川	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

	(2023年01月01日- 2023年06月30日)
本期已实现收益	466,685.50
本期利润	2,465,617.51
加权平均基金份额本期利润	0.0830
本期加权平均净值利润率	5.41%
本期基金份额净值增长率	3.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	13,129,794.35
期末可供分配基金份额利润	0.5016
期末基金资产净值	39,306,239.59
期末基金份额净值	1.5016
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	50.16%

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.17%	0.88%	-0.77%	0.89%	0.60%	-0.01%
过去三个月	-3.90%	0.78%	-5.10%	0.78%	1.20%	0.00%
过去六个月	3.51%	0.74%	2.20%	0.75%	1.31%	-0.01%

过去一年	-4.39%	0.90%	-6.65%	0.91%	2.26%	-0.01%
过去三年	8.99%	1.11%	2.48%	1.13%	6.51%	-0.02%
自基金合同生效起至今	50.16%	1.23%	34.65%	1.26%	15.51%	-0.03%

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

人保中证500指数型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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

§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1.5万亿元人民币，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。成立二十年来，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。二十年来，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；二十年来，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2023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、人保民富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		
石晓冉	基金经理	2020-08-03	-	6年	北京师范大学统计学硕士。曾任中信建投基金管理有限公司量化研究员。2018年8月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，历任量化研究员、基金经理助理，2020年8月3日起任人保沪深300指数型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金基金经理，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19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日至2023年7月19日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。
周剑	基金经理	2023-07-13	-	6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。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日。

2、非首任基金经理，其“任职日期”为公告确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，基金管理人根据基金合同约定，以坚持被动指数化投资为原则进行基金的投资运作，并通过定量技术对基金跟踪误差进行监控及分析。报告期内基金跟踪误差

来源主要是：1) 标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票；2) 基金的申购赎回；3) 成份股票的停牌。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保中证500基金份额净值为1.5016元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.51%，同期业绩比较基准收益率为2.20%。

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年下半年，经济延续弱复苏，全年大概率能够实现预期增长目标，企业盈利向上修复的可能性较高。当前A股整体盈利疲弱以及行业分化态势已基本被市场预期消化，基本体现在了市场表现中。向后看，伴随内需的渐进式修复、价格水平底部抬升，企业盈利趋于向上修复的概率加大，随着经济数据企稳并趋于边际改善，市场信心有望得以重建。我们将通过不断完善策略，适应新的市场环境，努力提升产品业绩。

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。

4.7 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

本报告期内，因赎回等原因，本基金自2023年2月13日至2023年6月30日连续94个工作日净值低于5000万，公司正在完善相关方案。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：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,055,112.29	2,044,363.86
结算备付金		4,374.42	86,950.25
存出保证金		17,850.61	7,333.50
交易性金融资产	6.4.7.2	36,377,656.72	40,853,907.68

其中：股票投资		36,377,656.72	39,836,758.72
基金投资		-	-
债券投资		-	1,017,148.96
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	-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		66,754.33	62,658.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		39,521,748.37	43,055,213.87
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		-	-
应付赎回款		106,410.78	245,268.28
应付管理人报酬		14,786.53	17,791.63

应付托管费		3,285.90	3,953.67
应付销售服务费		-	-
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	6.4.7.6	91,025.57	89,397.24
负债合计		215,508.78	356,410.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	26,176,445.24	29,433,072.77
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	13,129,794.35	13,265,730.28
净资产合计		39,306,239.59	42,698,803.05
负债和净资产总计		39,521,748.37	43,055,213.87

注：报告截止日2023年06月30日，人保中证500份额净值人民币1.5016元，基金份额总额26,176,445.24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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		2,723,774.46	-2,592,724.13
1.利息收入		14,036.49	8,167.21
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,036.49	8,153.21
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		-	14.00

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		656,005.45	1,427,445.70
其中：股票投资收益	6.4.7.10	257,762.16	957,628.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-1,405.36	8,086.99
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	399,648.65	461,729.81
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）	6.4.7.16	1,998,932.01	-4,047,465.80
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	54,800.51	19,128.76
减：二、营业总支出		258,156.95	237,706.39
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	103,927.83	79,764.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	23,095.07	17,725.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-

8. 其他费用	6.4.7.19	131,134.05	140,216.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,465,617.51	-2,830,430.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,465,617.51	-2,830,430.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,465,617.51	-2,830,430.52

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30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）	29,433,072.77	-	13,265,730.28	42,698,803.05
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）	29,433,072.77	-	13,265,730.28	42,698,803.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,256,627.53	-	-135,935.93	-3,392,563.46
（一）、综合收益总额	-	-	2,465,617.51	2,465,617.51

(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)	-3,256,627.53	-	-2,601,553.44	-5,858,180.97
其中: 1.基金申购款	28,377,466.06	-	14,502,291.34	42,879,757.40
2.基金赎回款	-31,634,093.59	-	-17,103,844.78	-48,737,938.37
(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)	26,176,445.24	-	13,129,794.35	39,306,239.59
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30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)	24,917,975.70	-	18,833,464.35	43,751,440.05
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）	24,917,975.70	-	18,833,464.35	43,751,440.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,903,050.34	-	-105,180.35	7,797,869.99
（一）、综合收益总额	-	-	-2,830,430.52	-2,830,430.52
（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）	7,903,050.34	-	2,725,250.17	10,628,300.51
其中：1.基金申购款	24,824,471.47	-	12,542,987.59	37,367,459.06
2.基金赎回款	-16,921,421.13	-	-9,817,737.42	-26,739,158.55
（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）	32,821,026.04	-	18,728,284.00	51,549,310.04

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：

黄本尧

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金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 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则》、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	3,055,112.29
等于：本金	3,054,502.78
加：应计利息	609.51
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	3,055,112.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	37,258,467.41	-	36,377,656.72	-880,810.69
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	37,258,467.41	-	36,377,656.72	-880,810.69

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

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	120.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,150.33
其中：交易所市场	11,150.33
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	29,754.59
其他应付	50,000.00
合计	91,025.57

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,433,072.77	29,433,072.77
本期申购	28,377,466.06	28,377,466.06
本期赎回（以“-”号填列）	-31,634,093.59	-31,634,093.59
本期末	26,176,445.24	26,176,445.24

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

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	34,290,594.43	-21,024,864.15	13,265,730.28
本期利润	466,685.50	1,998,932.01	2,465,617.51

本期基金份额交易产生的变动数	-3,892,444.35	1,290,890.91	-2,601,553.44
其中：基金申购款	33,117,784.86	-18,615,493.52	14,502,291.34
基金赎回款	-37,010,229.21	19,906,384.43	-17,103,844.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,864,835.58	-17,735,041.23	13,129,794.35

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
活期存款利息收入	13,437.85	
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	458.08	
其他	140.56	
合计	14,036.49	

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
卖出股票成交总额	38,463,475.73	
减：卖出股票成本总额	38,109,823.00	
减：交易费用	95,890.57	
买卖股票差价收入	257,762.16	

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	
	2023年01月01日至2023年06月30日	

债券投资收益——利息收入	688.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,093.70
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	-1,405.36

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
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,017,937.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	999,093.70
减：应计利息总额	20,937.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,093.70

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
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	399,648.65
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	399,648.65

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	1,998,932.01
——股票投资	1,996,738.61
——债券投资	2,193.40
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,998,932.01

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	54,800.51
合计	54,800.51

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 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	4,959.40
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,379.46
其他费用_指数使用费	100,000.00
合计	131,134.05

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

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	103,927.83	79,764.45
其中：支付销售机构的客户维护费	38,366.84	32,775.71

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 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	23,095.07	17,725.36

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

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	7,199,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	7,199,000.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

本报告期内基金管理人无运用自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基金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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	3,055,112.29	13,437.85	3,547,075.85	7,885.97

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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

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（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
------	------	------	------	------	------	-----	-----------	------------	------------	----

码	称	期	因	值 单 价	期	盘 单 价				
601 298	青 岛 港	202 3-0 6-2 8	重 大 事 项 停 牌	6.9 7	202 3-0 7-0 3	7.4 0	4,000	23,884.70	27,880.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 0 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,055,112.29	-	-	-	3,055,112.29
结算备付金	4,374.42	-	-	-	4,374.42
存出保证金	17,850.61	-	-	-	17,850.61
交易性金融资产	-	-	-	36,377,656.72	36,377,656.72
应收申购款	-	-	-	66,754.33	66,754.33
资产总计	3,077,337.32	-	-	36,444,411.05	39,521,748.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	106,410.78	106,410.78
应付管理人报酬	-	-	-	14,786.53	14,786.53
应付托管费	-	-	-	3,285.90	3,285.90
其他负债	-	-	-	91,025.57	91,025.57
负债总计	-	-	-	215,508.78	215,508.78
利率敏感度缺口	3,077,337.32	-	-	36,228,902.27	39,306,239.59
上年度末 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	2,044,363.86	-	-	-	2,044,363.86

结算备付金	86,950.25	-	-	-	86,950.25
存出保证金	7,333.50	-	-	-	7,333.50
交易性金融资产	1,017,148.96	-	-	39,836,758.72	40,853,907.68
应收申购款	-	-	-	62,658.58	62,658.58
资产总计	3,155,796.57	-	-	39,899,417.30	43,055,213.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	245,268.28	245,268.28
应付管理人报酬	-	-	-	17,791.63	17,791.63
应付托管费	-	-	-	3,953.67	3,953.67
其他负债	-	-	-	89,397.24	89,397.24
负债总计	-	-	-	356,410.82	356,410.82
利率敏感度缺口	3,155,796.57	-	-	39,543,006.48	42,698,803.05

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。

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1. 市场利率上升25个基点	-	-102.84
	2. 市场利率下降25个基点	-	103.13

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

于6月30日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022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	36,377,656.72	92.55	39,836,758.72	93.30
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	36,377,656.72	92.55	39,836,758.72	93.30

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1. 业绩比较基准增加5%	1,423,028.42	1,667,436.64
	2. 业绩比较基准减少5%	-1,423,028.42	-1,667,436.64

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公开报价。

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。

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	36,349,776.72	39,836,758.72
第二层次	27,880.00	1,017,148.96
第三层次	-	-
合计	36,377,656.72	40,853,907.68

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。

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；本基金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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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。

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	36,377,656.72	92.04
	其中：股票	36,377,656.72	92.04
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	3,059,486.71	7.74

8	其他各项资产	84,604.94	0.21
9	合计	39,521,748.37	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	266,236.00	0.68
B	采矿业	1,381,557.18	3.51
C	制造业	22,695,034.17	57.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,266,045.57	3.22
E	建筑业	407,350.00	1.04
F	批发和零售业	1,170,774.27	2.98
G	交通运输、仓储和邮政业	548,877.00	1.40
H	住宿和餐饮业	70,494.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,929,990.68	7.45
J	金融业	3,101,418.99	7.89
K	房地产业	517,104.70	1.32
L	租赁和商务服务业	458,175.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	384,290.00	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	211,948.26	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	190,001.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	501,859.63	1.28
S	综合	196,234.00	0.50
	合计	36,297,390.45	92.35

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	24,186.87	0.06
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,684.40	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	46,395.00	0.12
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	80,266.27	0.20

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	3,100	457,095.00	1.16
2	300418	昆仑万维	5,300	213,484.00	0.54
3	000988	华工科技	5,500	209,055.00	0.53
4	688256	寒武纪	1,100	206,800.00	0.53
5	002384	东山精密	7,600	196,840.00	0.50
6	002340	格林美	28,300	195,553.00	0.50
7	600372	中航电子	12,300	186,714.00	0.48
8	002422	科伦药业	6,200	184,016.00	0.47
9	300724	捷佳伟创	1,600	179,760.00	0.46
10	300012	华测检测	9,200	179,400.00	0.46
11	600157	永泰能源	122,300	173,666.00	0.44
12	688777	中控技术	2,755	172,958.90	0.44
13	600489	中金黄金	16,500	170,445.00	0.43
14	600079	人福医药	6,300	169,722.00	0.43
15	300003	乐普医疗	7,500	169,575.00	0.43
16	600487	亨通光电	10,900	159,794.00	0.41
17	002028	思源电气	3,400	158,848.00	0.40
18	601058	赛轮轮胎	13,500	153,765.00	0.39
19	601555	东吴证券	22,060	153,096.40	0.39
20	002463	沪电股份	7,300	152,862.00	0.39
21	300037	新宙邦	2,900	150,481.00	0.38
22	000066	中国长城	10,700	147,981.00	0.38
23	600885	宏发股份	4,620	147,147.00	0.37
24	002738	中矿资源	2,860	145,688.40	0.37
25	000807	云铝股份	11,419	145,363.87	0.37
26	002966	苏州银行	21,710	142,200.50	0.36
27	600352	浙江龙盛	14,800	138,380.00	0.35

28	600482	中国动力	5,900	138,296.00	0.35
29	000009	中国宝安	11,300	136,391.00	0.35
30	300146	汤臣倍健	5,600	134,288.00	0.34
31	600536	中国软件	2,861	134,123.68	0.34
32	000423	东阿阿胶	2,500	133,625.00	0.34
33	300058	蓝色光标	13,700	132,479.00	0.34
34	601077	渝农商行	36,700	131,753.00	0.34
35	002185	华天科技	14,200	130,640.00	0.33
36	601108	财通证券	17,900	129,596.00	0.33
37	600415	小商品城	15,100	128,803.00	0.33
38	600765	中航重机	4,780	126,717.80	0.32
39	002624	完美世界	7,500	126,675.00	0.32
40	002625	光启技术	8,300	126,658.00	0.32
41	688099	晶晨股份	1,500	126,480.00	0.32
42	600161	天坛生物	4,600	124,890.00	0.32
43	000783	长江证券	21,300	123,540.00	0.31
44	300285	国瓷材料	4,500	123,300.00	0.31
45	601233	桐昆股份	9,300	123,225.00	0.31
46	002008	大族激光	4,700	123,140.00	0.31
47	600096	云天化	7,100	121,197.00	0.31
48	600418	江淮汽车	9,600	120,864.00	0.31
49	603882	金域医学	1,600	120,800.00	0.31
50	002223	鱼跃医疗	3,350	120,566.50	0.31
51	002385	大北农	18,200	120,120.00	0.31
52	600027	华电国际	17,900	119,751.00	0.30
53	688301	奕瑞科技	420	118,620.60	0.30
54	000630	铜陵有色	41,000	118,490.00	0.30
55	002407	多氟多	5,920	117,571.20	0.30
56	002409	雅克科技	1,600	116,608.00	0.30
57	600862	中航高科	4,600	116,426.00	0.30
58	603688	石英股份	1,000	113,840.00	0.29

59	601162	天风证券	38,200	113,836.00	0.29
60	300024	机器人	6,800	113,356.00	0.29
61	000933	神火股份	8,700	113,100.00	0.29
62	002156	通富微电	5,000	113,000.00	0.29
63	300474	景嘉微	1,250	112,487.50	0.29
64	002497	雅化集团	6,300	112,014.00	0.28
65	600705	中航产融	29,200	111,836.00	0.28
66	002240	盛新锂能	3,500	111,545.00	0.28
67	300073	当升科技	2,200	110,726.00	0.28
68	601168	西部矿业	10,500	110,355.00	0.28
69	002439	启明星辰	3,700	110,112.00	0.28
70	600563	法拉电子	800	109,840.00	0.28
71	000932	华菱钢铁	22,880	109,137.60	0.28
72	600060	海信视像	4,400	108,900.00	0.28
73	300395	菲利华	2,200	108,240.00	0.28
74	600066	宇通客车	7,300	107,602.00	0.27
75	002138	顺络电子	4,500	107,595.00	0.27
76	000975	银泰黄金	9,160	107,172.00	0.27
77	002600	领益智造	15,500	107,105.00	0.27
78	300144	宋城演艺	8,600	106,640.00	0.27
79	300136	信维通信	5,300	106,424.00	0.27
80	002797	第一创业	18,500	105,820.00	0.27
81	002850	科达利	800	105,800.00	0.27
82	600109	国金证券	12,200	105,774.00	0.27
83	002465	海格通信	10,200	105,468.00	0.27
84	002568	百润股份	2,900	105,415.00	0.27
85	600298	安琪酵母	2,900	105,009.00	0.27
86	600873	梅花生物	11,700	104,481.00	0.27
87	600879	航天电子	12,200	103,578.00	0.26
88	603596	伯特利	1,300	103,038.00	0.26
89	603816	顾家家居	2,700	103,005.00	0.26

90	300253	卫宁健康	9,500	102,790.00	0.26
91	600839	四川长虹	20,329	102,661.45	0.26
92	600160	巨化股份	7,441	102,536.98	0.26
93	603939	益丰药房	2,760	102,120.00	0.26
94	000021	深科技	5,100	101,949.00	0.26
95	688521	芯原股份	1,400	100,688.00	0.26
96	000683	远兴能源	14,000	100,660.00	0.26
97	600392	盛和资源	7,800	100,386.00	0.26
98	300832	新产业	1,700	100,300.00	0.26
99	601990	南京证券	12,200	99,796.00	0.25
100	300604	长川科技	2,100	99,729.00	0.25
101	600497	驰宏锌锗	19,600	98,392.00	0.25
102	600988	赤峰黄金	7,300	98,258.00	0.25
103	603444	吉比特	200	98,222.00	0.25
104	601696	中银证券	9,200	98,072.00	0.25
105	300568	星源材质	5,700	97,983.00	0.25
106	600177	雅戈尔	15,500	97,805.00	0.25
107	300118	东方日升	3,800	97,394.00	0.25
108	300390	天华新能	2,720	97,376.00	0.25
109	000729	燕京啤酒	7,800	97,266.00	0.25
110	002294	信立泰	3,100	96,689.00	0.25
111	688169	石头科技	300	96,204.00	0.24
112	600486	扬农化工	1,100	96,162.00	0.24
113	002025	航天电器	1,500	95,700.00	0.24
114	600141	兴发集团	4,300	95,546.00	0.24
115	002368	太极股份	2,320	95,514.40	0.24
116	605358	立昂微	2,600	95,498.00	0.24
117	300017	网宿科技	13,400	95,274.00	0.24
118	002078	太阳纸业	8,900	95,141.00	0.24
119	000831	中国稀土	3,200	94,720.00	0.24
120	601577	长沙银行	12,200	94,672.00	0.24

121	600642	申能股份	13,523	94,525.77	0.24
122	000728	国元证券	14,400	93,888.00	0.24
123	603589	口子窖	1,900	93,765.00	0.24
124	300487	蓝晓科技	1,500	93,630.00	0.24
125	002673	西部证券	14,700	93,345.00	0.24
126	601997	贵阳银行	18,000	92,880.00	0.24
127	000629	钒钛股份	23,700	92,667.00	0.24
128	600699	均胜电子	5,240	92,433.60	0.24
129	600166	福田汽车	27,100	92,140.00	0.23
130	002268	电科网安	3,300	91,971.00	0.23
131	002273	水晶光电	7,698	91,914.12	0.23
132	600325	华发股份	9,300	91,605.00	0.23
133	600549	厦门钨业	4,800	91,344.00	0.23
134	002195	二三四五	31,550	91,179.50	0.23
135	600118	中国卫星	3,200	90,272.00	0.23
136	600521	华海药业	4,900	90,209.00	0.23
137	000591	太阳能	13,300	90,174.00	0.23
138	000400	许继电气	3,900	89,895.00	0.23
139	002444	巨星科技	4,100	89,708.00	0.23
140	688002	睿创微纳	2,000	89,600.00	0.23
141	600153	建发股份	8,200	89,462.00	0.23
142	000998	隆平高科	5,800	89,030.00	0.23
143	600399	抚顺特钢	8,700	88,740.00	0.23
144	688567	孚能科技	4,084	88,173.56	0.22
145	688390	固德威	528	88,102.08	0.22
146	000997	新大陆	4,650	87,885.00	0.22
147	000738	航发控制	3,600	87,840.00	0.22
148	603000	人民网	3,000	87,600.00	0.22
149	600637	东方明珠	11,200	87,584.00	0.22
150	300866	安克创新	1,000	87,500.00	0.22
151	600143	金发科技	10,000	87,300.00	0.22

152	600859	王府井	4,400	87,076.00	0.22
153	002065	东华软件	12,300	86,838.00	0.22
154	601198	东兴证券	10,700	85,814.00	0.22
155	002131	利欧股份	37,200	85,560.00	0.22
156	000960	锡业股份	5,500	85,525.00	0.22
157	002683	广东宏大	2,900	85,376.00	0.22
158	600499	科达制造	7,500	85,200.00	0.22
159	688072	拓荆科技	200	85,194.00	0.22
160	000519	中兵红箭	4,700	85,023.00	0.22
161	600704	物产中大	17,200	84,968.00	0.22
162	300383	光环新网	7,900	84,925.00	0.22
163	000703	恒逸石化	12,500	84,750.00	0.22
164	300676	华大基因	1,400	83,986.00	0.21
165	300699	光威复材	2,720	83,912.00	0.21
166	002056	横店东磁	4,600	83,766.00	0.21
167	600271	航天信息	6,100	83,509.00	0.21
168	002373	千方科技	6,100	83,204.00	0.21
169	300001	特锐德	4,000	83,120.00	0.21
170	603077	和邦生物	34,000	82,620.00	0.21
171	688009	中国通号	14,227	82,516.60	0.21
172	603737	三棵树	1,260	82,429.20	0.21
173	000623	吉林敖东	5,118	82,092.72	0.21
174	600516	方大炭素	13,200	81,840.00	0.21
175	300438	鹏辉能源	1,700	81,668.00	0.21
176	002507	涪陵榨菜	4,450	81,479.50	0.21
177	300088	长信科技	13,500	81,405.00	0.21
178	600380	健康元	6,400	81,344.00	0.21
179	002299	圣农发展	4,200	80,430.00	0.20
180	600348	华阳股份	10,150	80,286.50	0.20
181	002192	融捷股份	1,200	80,196.00	0.20
182	600498	烽火通信	3,900	79,443.00	0.20

183	600529	山东药玻	2,900	78,938.00	0.20
184	601016	节能风电	21,500	78,905.00	0.20
185	600998	九州通	7,599	78,877.62	0.20
186	600170	上海建工	29,200	78,548.00	0.20
187	002152	广电运通	6,700	78,524.00	0.20
188	603338	浙江鼎力	1,400	78,414.00	0.20
189	600867	通化东宝	7,500	78,300.00	0.20
190	002203	海亮股份	6,507	78,149.07	0.20
191	600546	山煤国际	5,400	78,138.00	0.20
192	002281	光迅科技	2,100	77,889.00	0.20
193	000513	丽珠集团	2,000	77,820.00	0.20
194	600511	国药股份	2,000	77,700.00	0.20
195	002531	天顺风能	5,100	77,673.00	0.20
196	600739	辽宁成大	5,900	77,585.00	0.20
197	002595	豪迈科技	2,200	77,286.00	0.20
198	002532	天山铝业	12,700	76,073.00	0.19
199	002080	中材科技	3,700	75,924.00	0.19
200	601636	旗滨集团	8,800	75,856.00	0.19
201	002936	郑州银行	32,900	75,670.00	0.19
202	688516	奥特维	400	75,360.00	0.19
203	002739	万达电影	6,000	75,240.00	0.19
204	600528	中铁工业	7,600	75,088.00	0.19
205	603927	中科软	1,940	74,806.40	0.19
206	603517	绝味食品	2,000	74,300.00	0.19
207	600863	内蒙华电	17,900	74,285.00	0.19
208	000878	云南铜业	6,709	74,134.45	0.19
209	300070	碧水源	13,800	73,968.00	0.19
210	600970	中材国际	5,800	73,950.00	0.19
211	002432	九安医疗	2,100	73,941.00	0.19
212	002092	中泰化学	11,400	73,530.00	0.19
213	601966	玲珑轮胎	3,300	73,326.00	0.19

214	300212	易华录	2,200	73,106.00	0.19
215	600580	卧龙电驱	5,000	73,050.00	0.19
216	000547	航天发展	7,281	72,810.00	0.19
217	600820	隧道股份	12,100	72,721.00	0.19
218	600416	湘电股份	3,800	72,542.00	0.18
219	300296	利亚德	11,100	72,483.00	0.18
220	600909	华安证券	15,520	72,478.40	0.18
221	300595	欧普康视	2,400	72,456.00	0.18
222	002430	杭氧股份	2,100	72,156.00	0.18
223	002372	伟星新材	3,500	71,890.00	0.18
224	600329	达仁堂	1,600	71,824.00	0.18
225	002926	华西证券	8,600	71,466.00	0.18
226	300182	捷成股份	11,305	71,334.55	0.18
227	000027	深圳能源	10,820	71,303.80	0.18
228	600481	双良节能	5,100	71,298.00	0.18
229	600535	天士力	4,900	71,099.00	0.18
230	600258	首旅酒店	3,720	70,494.00	0.18
231	002353	杰瑞股份	2,800	70,364.00	0.18
232	603233	大参林	2,500	70,025.00	0.18
233	000750	国海证券	20,900	70,015.00	0.18
234	000039	中集集团	10,120	69,726.80	0.18
235	600008	首创环保	24,200	69,696.00	0.18
236	603160	汇顶科技	1,500	69,375.00	0.18
237	300244	迪安诊断	2,700	69,201.00	0.18
238	603156	养元饮品	2,800	69,160.00	0.18
239	002429	兆驰股份	12,500	68,750.00	0.17
240	002557	洽洽食品	1,652	68,640.60	0.17
241	002958	青农商行	25,200	68,544.00	0.17
242	603456	九洲药业	2,500	68,450.00	0.17
243	000060	中金岭南	14,400	68,400.00	0.17
244	000970	中科三环	5,300	67,946.00	0.17

245	600655	豫园股份	9,900	67,914.00	0.17
246	300682	朗新科技	2,900	67,512.00	0.17
247	000636	风华高科	4,400	67,496.00	0.17
248	600398	海澜之家	9,800	67,424.00	0.17
249	600755	厦门国贸	8,700	67,338.00	0.17
250	300357	我武生物	2,000	67,260.00	0.17
251	603658	安图生物	1,300	67,249.00	0.17
252	300558	贝达药业	1,400	67,242.00	0.17
253	600369	西南证券	18,300	66,795.00	0.17
254	600021	上海电力	6,200	66,774.00	0.17
255	600390	五矿资本	12,400	66,712.00	0.17
256	300009	安科生物	6,656	66,560.00	0.17
257	000830	鲁西化工	6,300	66,528.00	0.17
258	002506	协鑫集成	22,500	65,925.00	0.17
259	002500	山西证券	11,800	65,844.00	0.17
260	002508	老板电器	2,600	65,754.00	0.17
261	603893	瑞芯微	900	65,565.00	0.17
262	600435	北方导航	5,702	65,515.98	0.17
263	601880	辽港股份	41,500	64,740.00	0.16
264	002128	电投能源	4,880	64,513.60	0.16
265	000050	深天马 A	7,000	64,260.00	0.16
266	600038	中直股份	1,600	63,712.00	0.16
267	603712	七一二	2,100	63,441.00	0.16
268	600985	淮北矿业	5,449	62,772.48	0.16
269	002572	索菲亚	3,600	62,712.00	0.16
270	002244	滨江集团	7,100	62,622.00	0.16
271	300026	红日药业	11,550	62,601.00	0.16
272	300529	健帆生物	2,700	62,586.00	0.16
273	600848	上海临港	5,200	62,140.00	0.16
274	300363	博腾股份	2,100	62,139.00	0.16
275	601456	国联证券	6,800	61,880.00	0.16

275	002153	石基信息	4,420	61,880.00	0.16
277	603858	步长制药	3,000	61,770.00	0.16
278	002408	齐翔腾达	9,640	61,406.80	0.16
279	002019	亿帆医药	4,200	61,320.00	0.16
280	600895	张江高科	4,400	61,248.00	0.16
281	688200	华峰测控	400	61,200.00	0.16
282	300373	扬杰科技	1,500	60,855.00	0.15
283	601179	中国西电	11,200	60,592.00	0.15
284	600208	新湖中宝	24,400	60,512.00	0.15
285	000155	川能动力	4,200	60,480.00	0.15
286	600827	百联股份	4,515	60,365.55	0.15
287	600378	昊华科技	1,600	60,224.00	0.15
288	600673	东阳光	8,300	59,843.00	0.15
289	601717	郑煤机	4,800	59,760.00	0.15
290	601000	唐山港	16,800	59,304.00	0.15
291	601665	齐鲁银行	15,100	59,192.00	0.15
292	601958	金钼股份	5,300	59,095.00	0.15
293	600282	南钢股份	17,500	58,975.00	0.15
294	600667	太极实业	8,100	58,806.00	0.15
295	000739	普洛药业	3,300	58,542.00	0.15
296	000887	中鼎股份	4,470	58,512.30	0.15
297	600566	济川药业	2,000	58,080.00	0.15
298	002670	国盛金控	6,600	57,948.00	0.15
299	002155	湖南黄金	4,748	57,925.60	0.15
300	600959	江苏有线	17,000	57,460.00	0.15
301	000893	亚钾国际	2,500	57,350.00	0.15
302	300115	长盈精密	4,800	57,168.00	0.15
303	601231	环旭电子	3,800	56,848.00	0.14
303	300748	金力永磁	1,900	56,848.00	0.14
305	600171	上海贝岭	3,100	56,575.00	0.14
306	601666	平煤股份	7,400	55,796.00	0.14

307	601866	中远海发	22,500	55,575.00	0.14
308	603885	吉祥航空	3,600	55,548.00	0.14
309	000778	新兴铸管	13,600	55,488.00	0.14
310	000598	兴蓉环境	10,200	55,386.00	0.14
311	600517	国网英大	9,700	55,290.00	0.14
312	603218	日月股份	2,900	55,071.00	0.14
313	300677	英科医疗	2,500	55,000.00	0.14
314	600056	中国医药	4,220	54,775.60	0.14
315	300251	光线传媒	6,700	54,203.00	0.14
316	600316	洪都航空	2,300	53,935.00	0.14
317	002939	长城证券	6,600	53,658.00	0.14
318	002030	达安基因	5,373	53,568.81	0.14
319	002326	永太科技	3,500	53,515.00	0.14
320	601005	重庆钢铁	38,100	53,340.00	0.14
321	600598	北大荒	4,000	53,320.00	0.14
322	603127	昭衍新药	1,300	53,170.00	0.14
323	000709	河钢股份	23,500	53,110.00	0.14
324	600582	天地科技	9,100	53,053.00	0.13
325	002249	大洋电机	9,300	53,010.00	0.13
326	688188	柏楚电子	280	52,796.80	0.13
327	600906	财达证券	7,330	52,776.00	0.13
328	002183	怡亚通	10,340	52,734.00	0.13
329	000987	越秀资本	8,285	52,609.75	0.13
330	600131	国网信通	2,600	52,494.00	0.13
331	002487	大金重工	1,700	52,428.00	0.13
332	601106	中国一重	15,600	52,416.00	0.13
333	603267	鸿远电子	800	52,240.00	0.13
334	600718	东软集团	4,900	52,234.00	0.13
335	600315	上海家化	1,800	52,218.00	0.13
336	002518	科士达	1,300	52,013.00	0.13
337	300776	帝尔激光	800	51,920.00	0.13

338	600373	中文传媒	3,894	51,868.08	0.13
339	000930	中粮科技	6,400	51,840.00	0.13
340	002985	北摩高科	1,173	51,752.76	0.13
341	601992	金隅集团	23,700	51,666.00	0.13
342	603568	伟明环保	2,926	51,234.26	0.13
343	000883	湖北能源	11,200	51,072.00	0.13
344	002266	浙富控股	12,200	50,386.00	0.13
345	688116	天奈科技	1,100	50,325.00	0.13
346	000825	太钢不锈	13,000	50,310.00	0.13
347	002511	中顺洁柔	4,500	50,175.00	0.13
348	601778	晶科科技	10,100	49,894.00	0.13
349	688778	厦钨新能	1,000	49,500.00	0.13
350	002690	美亚光电	1,911	49,208.25	0.13
351	600737	中粮糖业	6,100	49,105.00	0.12
352	601928	凤凰传媒	4,300	49,020.00	0.12
353	002831	裕同科技	1,989	48,511.71	0.12
354	600967	内蒙一机	4,800	48,480.00	0.12
355	603529	爱玛科技	1,500	48,330.00	0.12
356	600801	华新水泥	3,900	48,165.00	0.12
357	600297	广汇汽车	23,000	47,840.00	0.12
358	603225	新凤鸣	4,320	47,736.00	0.12
359	300861	美畅股份	1,100	47,707.00	0.12
360	601187	厦门银行	9,500	47,690.00	0.12
361	601098	中南传媒	4,090	47,444.00	0.12
362	603026	胜华新材	800	47,400.00	0.12
363	600663	陆家嘴	4,800	47,376.00	0.12
364	603228	景旺电子	1,847	47,375.55	0.12
365	002745	木林森	5,100	46,920.00	0.12
366	000012	南玻 A	7,848	46,774.08	0.12
367	002221	东华能源	5,400	46,710.00	0.12
368	600500	中化国际	8,400	46,704.00	0.12

369	601991	大唐发电	14,100	46,671.00	0.12
370	002468	申通快递	4,300	46,526.00	0.12
371	003035	南网能源	6,500	46,280.00	0.12
372	000156	华数传媒	5,300	46,110.00	0.12
373	600871	石化油服	23,100	45,738.00	0.12
374	603883	老百姓	1,530	45,670.50	0.12
375	688208	道通科技	1,500	45,465.00	0.12
376	002791	坚朗五金	700	45,297.00	0.12
377	002032	苏泊尔	900	45,000.00	0.11
378	601611	中国核建	5,300	44,785.00	0.11
379	601718	际华集团	15,000	44,550.00	0.11
380	000401	冀东水泥	6,000	44,220.00	0.11
381	600022	山东钢铁	31,060	44,105.20	0.11
382	000581	威孚高科	2,800	44,100.00	0.11
383	002250	联化科技	4,200	43,932.00	0.11
384	688276	百克生物	700	43,820.00	0.11
385	688538	和辉光电	17,217	43,731.18	0.11
386	002867	周大生	2,450	43,561.00	0.11
387	601118	海南橡胶	9,700	43,456.00	0.11
388	002010	传化智联	8,000	42,560.00	0.11
389	688520	神州细胞	750	42,555.00	0.11
390	300888	稳健医疗	1,020	42,503.40	0.11
391	000785	居然之家	11,100	42,291.00	0.11
392	601598	中国外运	9,000	41,940.00	0.11
393	600126	杭钢股份	9,600	41,664.00	0.11
394	601608	中信重工	9,883	41,607.43	0.11
395	002423	中粮资本	5,200	41,600.00	0.11
396	600062	华润双鹤	2,360	41,111.20	0.10
397	000559	万向钱潮	7,483	40,782.35	0.10
398	002081	金螳螂	9,000	40,590.00	0.10
399	600597	光明乳业	3,900	40,560.00	0.10

400	688281	华秦科技	200	40,500.00	0.10
401	600782	新钢股份	10,900	40,439.00	0.10
402	000089	深圳机场	5,800	40,310.00	0.10
403	600155	华创云信	6,447	40,100.34	0.10
404	603826	坤彩科技	800	40,000.00	0.10
405	600259	广晟有色	1,100	39,754.00	0.10
406	603638	艾迪精密	1,920	39,398.40	0.10
407	600901	江苏金租	9,520	39,317.60	0.10
408	600707	彩虹股份	8,200	39,032.00	0.10
409	300618	寒锐钴业	1,200	38,892.00	0.10
410	600339	中油工程	9,500	38,665.00	0.10
411	000937	冀中能源	6,000	38,280.00	0.10
412	600095	湘财股份	4,900	38,220.00	0.10
413	600409	三友化工	7,000	38,150.00	0.10
414	002761	浙江建投	2,500	37,950.00	0.10
415	000898	鞍钢股份	13,600	37,808.00	0.10
416	300850	新强联	1,000	37,380.00	0.10
417	603707	健友股份	2,762	37,287.00	0.09
418	300482	万孚生物	1,400	37,282.00	0.09
419	603866	桃李面包	3,630	36,735.60	0.09
420	000537	广宇发展	3,140	36,643.80	0.09
421	600928	西安银行	10,400	36,608.00	0.09
422	000967	盈峰环境	7,200	36,360.00	0.09
423	600167	联美控股	5,200	36,244.00	0.09
424	600556	天下秀	5,100	36,159.00	0.09
425	001914	招商积余	2,400	36,120.00	0.09
426	601568	北元集团	6,780	35,730.60	0.09
427	600968	海油发展	11,500	35,305.00	0.09
428	600808	马钢股份	13,700	35,209.00	0.09
429	601156	东航物流	2,700	35,100.00	0.09
430	000563	陕国投 A	11,500	35,075.00	0.09

431	688385	复旦微电	700	35,070.00	0.09
432	002925	盈趣科技	1,800	34,920.00	0.09
433	300257	开山股份	2,300	34,891.00	0.09
434	600507	方大特钢	7,498	34,715.74	0.09
435	600195	中牧股份	2,944	34,385.92	0.09
436	688029	南微医学	420	34,255.20	0.09
437	002505	鹏都农牧	18,100	34,209.00	0.09
438	300442	润泽科技	1,100	33,836.00	0.09
439	603379	三美股份	1,420	33,384.20	0.08
440	603650	彤程新材	1,000	32,800.00	0.08
441	600764	中国海防	1,200	32,664.00	0.08
442	688185	康希诺	400	32,600.00	0.08
443	002608	江苏国信	4,300	32,551.00	0.08
444	002705	新宝股份	1,800	32,454.00	0.08
445	688006	杭可科技	1,060	32,298.20	0.08
446	688052	纳芯微	200	31,674.00	0.08
447	000959	首钢股份	8,900	31,150.00	0.08
448	000402	金融街	6,809	30,776.68	0.08
449	002563	森马服饰	4,800	29,856.00	0.08
450	601828	美凯龙	6,200	29,698.00	0.08
451	000415	渤海租赁	14,100	29,610.00	0.08
452	002110	三钢闽光	7,000	29,540.00	0.08
453	688819	天能股份	800	29,472.00	0.07
454	001203	大中矿业	2,600	28,886.00	0.07
455	688289	圣湘生物	1,700	28,628.00	0.07
456	002653	海思科	1,200	28,320.00	0.07
457	688779	长远锂科	2,500	28,175.00	0.07
458	000031	大悦城	7,667	28,061.22	0.07
459	601298	青岛港	4,000	27,880.00	0.07
460	603056	德邦股份	1,800	27,756.00	0.07
461	603317	天味食品	1,899	27,744.39	0.07

462	600377	宁沪高速	2,800	27,524.00	0.07
463	600623	华谊集团	4,285	26,695.55	0.07
464	002399	海普瑞	2,271	26,048.37	0.07
465	601869	长飞光纤	700	25,907.00	0.07
466	601139	深圳燃气	3,500	25,515.00	0.06
467	600350	山东高速	3,900	24,843.00	0.06
468	000869	张裕 A	800	24,528.00	0.06
469	601969	海南矿业	3,700	24,346.00	0.06
470	601136	首创证券	1,700	24,089.00	0.06
471	001872	招商港口	1,300	22,451.00	0.06
472	688082	盛美上海	200	22,080.00	0.06
473	600995	南网储能	2,000	22,020.00	0.06
474	000553	安道麦 A	2,500	21,100.00	0.05
475	002945	华林证券	1,500	20,520.00	0.05
476	001227	兰州银行	6,800	19,448.00	0.05
477	601228	广州港	6,000	19,380.00	0.05
478	603868	飞科电器	300	18,927.00	0.05
479	600299	安迪苏	2,300	18,331.00	0.05
480	603355	莱克电气	700	17,787.00	0.05
481	000958	电投产融	4,000	17,320.00	0.04
482	601158	重庆水务	3,100	17,236.00	0.04
483	688107	安路科技	300	16,617.00	0.04
484	301029	怡合达	360	16,084.80	0.04
485	688248	南网科技	400	15,356.00	0.04
486	688220	翱捷科技	200	15,078.00	0.04
487	600032	浙江新能	1,200	15,072.00	0.04
488	300741	华宝股份	700	14,994.00	0.04
489	600956	新天绿能	1,700	14,824.00	0.04
490	688234	天岳先进	200	14,788.00	0.04
491	688295	中复神鹰	400	14,672.00	0.04
492	600927	永安期货	900	14,634.00	0.04

493	603786	科博达	200	13,140.00	0.03
494	688772	珠海冠宇	600	12,090.00	0.03
495	688690	纳微科技	300	11,655.00	0.03
496	002901	大博医疗	300	9,324.00	0.02
497	688105	诺唯赞	200	6,098.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000656	金科股份	23,900	26,529.00	0.07
2	001337	四川黄金	783	24,186.87	0.06
3	002146	荣盛发展	12,900	19,866.00	0.05
4	603162	海通发展	568	9,684.40	0.02
5	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	002966	苏州银行	243,350.00	0.57
2	002340	格林美	213,064.00	0.50
3	300012	华测检测	199,820.00	0.47
4	300308	中际旭创	198,533.00	0.46
5	002384	东山精密	191,997.00	0.45
6	600157	永泰能源	182,741.00	0.43
7	002422	科伦药业	179,356.00	0.42
8	000807	云铝股份	171,420.00	0.40
9	600487	亨通光电	170,042.00	0.40
10	603517	绝味食品	168,116.00	0.39
11	603613	国联股份	159,251.00	0.37

12	600885	宏发股份	157,580.00	0.37
13	002625	光启技术	157,050.00	0.37
14	002028	思源电气	155,264.00	0.36
15	600372	中航电子	154,755.00	0.36
16	300037	新宙邦	154,238.00	0.36
17	300724	捷佳伟创	151,981.00	0.36
18	600079	人福医药	151,348.00	0.35
19	601555	东吴证券	150,918.00	0.35
20	300073	当升科技	150,492.00	0.35

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	603613	国联股份	279,698.50	0.66
2	601607	上海医药	267,841.00	0.63
3	603605	珀莱雅	257,109.16	0.60
4	002340	格林美	252,421.00	0.59
5	000999	华润三九	248,505.00	0.58
6	603345	安井食品	248,432.00	0.58
7	002384	东山精密	248,361.00	0.58
8	688122	西部超导	247,978.86	0.58
9	300012	华测检测	232,880.00	0.55
10	601872	招商轮船	231,495.00	0.54
11	600157	永泰能源	217,551.00	0.51
12	600026	中远海能	207,994.00	0.49
13	600536	中国软件	195,645.00	0.46
14	601699	潞安环能	191,947.00	0.45
15	000009	中国宝安	190,651.00	0.45
16	600885	宏发股份	188,702.00	0.44

17	603517	绝味食品	186,600.00	0.44
18	002422	科伦药业	185,047.00	0.43
19	600487	亨通光电	184,100.00	0.43
20	002603	以岭药业	183,864.00	0.43

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	32,653,982.39
卖出股票收入（成交）总额	38,463,475.73

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 昆仑万维（昆仑万维 300418）为本基金前十大持仓证券。2023年3月26日，昆仑万维科技股份有限公司收到深圳证券交易所出具的《关于对昆仑万维科技股份有限公司的监管函》（创业板监管函〔2023〕第38号），其中提及昆仑万维科技股份有限公司在ChatGPT及相关概念受投资者广泛关注的背景下，通过互动易回复投资者咨询时未能客观、完整地介绍和反映公司相关业务的实际情况、对公司业绩的影响及充分提示相关风险。上述行为违反了深圳证券交易所《创业板股票上市规则（2023年修订）》第1.4条，第5.1.1条及《上市公司自律监管指引第2号--创业板上市公司规范运作》第8.1.1条的规定，深圳证券交易所要求昆仑万维科技股份有限公司董事会充分重视，吸取教训，及时整改，杜绝前述问题再次发生。

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规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	17,850.61
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	66,754.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,604.94

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000540	*ST中天	-	0.00	摘牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
6,550	3,996.40	0.00	0.00%	26,176,445.24	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	48,534.10	0.19%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年12月07日)基金份额总额	255,386,460.94
----------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	29,433,072.77
本报告期基金总申购份额	28,377,466.06
减：本报告期基金总赎回份额	31,634,093.59
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	26,176,445.24

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

2023年3月29日，本基金管理人发布《中国人保资产管理有限公司高级管理人员变更公告》，罗熹先生因年龄原因，辞去本公司董事长职务，该辞任自2023年3月16日生效。2023年3月31日，本基金管理人发布《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》，自2023年3月29日聘任郭乐琦女士担任公募基金合规负责人（督察长）。

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	440,366.40	0.62%	322.08	0.62%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	28,732,349.26	40.53%	21,012.57	40.53%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	7,061,124.80	9.96%	5,163.68	9.96%	-
中信证券	1	34,660,275.46	48.89%	25,347.26	48.89%	-

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：

本基金本报告期无新增交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金2022年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
2	人保中证500指数型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
3	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	2023-03-28
4	人保中证500指数型证券投资基金招募说明书更新(2023年第1号)	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-28
5	人保中证500指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-28
6	中国人保资产管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-29
7	公司旗下部分基金2022年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-30
8	人保中证500指数型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-30
9	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	2023-03-31
10	关于旗下基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-12
11	中国人保资产管理有限公司	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21

	旗下基金季度报告提示性公告		
12	人保中证500指数型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21
13	关于旗下基金参与上海利得基金销售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	2023-06-21
14	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	2023-06-26

§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

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区西长安街88号中国人保大厦
基金托管人地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

二〇二三年八月三十日