

人保沪深300指数型证券投资基金

2024年第4季度报告

2024年12月31日

基金管理人:中国人保资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2025年01月21日

目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示 | 3 |
| §2 基金产品概况 | 3 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 4 |
| 3.1 主要财务指标 | 4 |
| 3.2 基金净值表现 | 4 |
| §4 管理人报告 | 6 |
| 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 | 6 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 7 |
| 4.3 公平交易专项说明 | 7 |
| 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析 | 7 |
| 4.5 报告期内基金的业绩表现 | 7 |
| 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 | 7 |
| §5 投资组合报告 | 8 |
| 5.1 报告期末基金资产组合情况 | 8 |
| 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 8 |
| 5.3 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 | 10 |
| 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合 | 11 |
| 5.5 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债券投资明细 | 11 |
| 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细 | 11 |
| 5.7 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 | 11 |
| 5.8 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权证投资明细 | 11 |
| 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 12 |
| 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 12 |
| 5.11 投资组合报告附注 | 12 |
| §6 开放式基金份额变动 | 14 |
| §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 | 14 |
| 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况 | 14 |
| 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 | 15 |
| §8 影响投资者决策的其他重要信息 | 15 |
| 8.1 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 | 15 |
| 8.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 15 |
| §9 备查文件目录 | 15 |
| 9.1 备查文件目录 | 15 |
| 9.2 存放地点 | 15 |
| 9.3 查阅方式 | 16 |

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

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2025年1月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 人保沪深300 |
| 基金主代码 | 006600 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019年02月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,058,968,517.57份 |
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深300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 | 沪深300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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 人保沪深300A | 人保沪深300C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006600 | 021635 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,011,580,287.88份 | 47,388,229.69份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2024年10月01日 - 2024年12月31日) | |
|----------------|--------------------------------|---------------|
| | 人保沪深300A | 人保沪深300C |
| 1.本期已实现收益 | -477,987.85 | -189,037.63 |
| 2.本期利润 | -27,899,167.20 | -1,162,376.67 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0330 | -0.0423 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,151,567,845.39 | 55,702,165.33 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1384 | 1.1754 |

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、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

人保沪深300A净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -0.97% | 1.67% | -1.92% | 1.65% | 0.95% | 0.02% |
| 过去六个月 | 15.85% | 1.58% | 13.05% | 1.58% | 2.80% | 0.00% |
| 过去一年 | 17.87% | 1.28% | 14.04% | 1.27% | 3.83% | 0.01% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去三年 | -15.09% | 1.10% | -19.21% | 1.12% | 4.12% | -0.02% |
| 过去五年 | 20.14% | 1.15% | -3.24% | 1.17% | 23.38% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.86% | 1.13% | 7.27% | 1.16% | 26.59% | -0.03% |

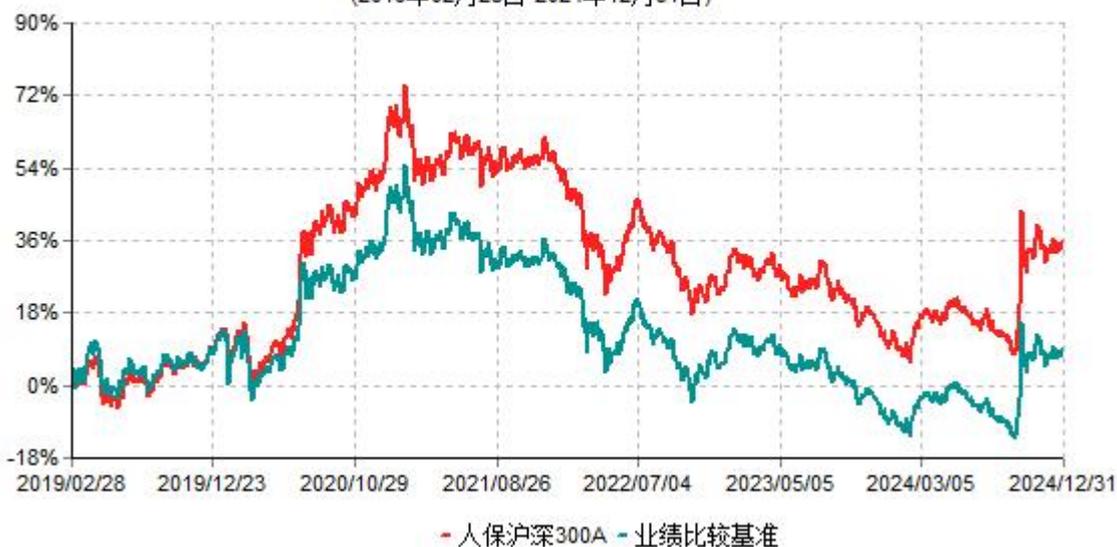
人保沪深300C净值表现

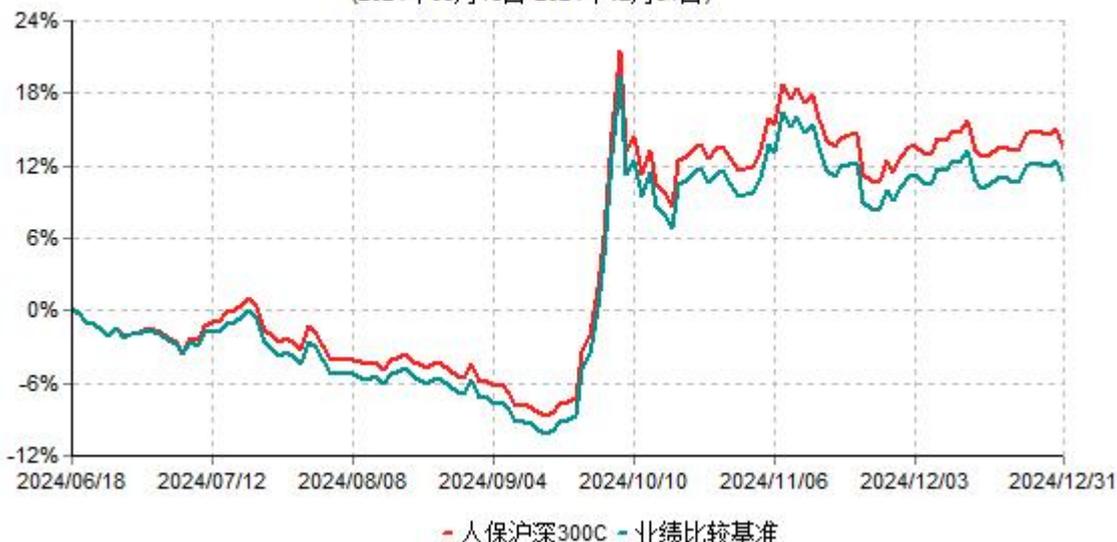
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -1.10% | 1.67% | -1.92% | 1.65% | 0.82% | 0.02% |
| 过去六个月 | 15.58% | 1.58% | 13.05% | 1.58% | 2.53% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 13.41% | 1.53% | 10.78% | 1.52% | 2.63% | 0.01% |

注：本基金自2024年6月18日起增加C类份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

人保沪深300A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年02月28日-2024年12月31日)



人保沪深300C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年06月18日-2024年12月31日)

- 注：1、本基金基金合同于2019年2月28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：沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。
- 3、本基金自2024年6月18日起增加C类份额。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 周剑 | 基金经理 | 2023-09-15 | - | 7.8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。 |

- 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》、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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的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沪深300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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保沪深300A基金份额净值为1.1384元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.97%，同期业绩比较基准收益率为-1.92%；截至报告期末人保沪深300C基金份额净值为1.1754元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.10%，同期业绩比较基准收益率为-1.92%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 1,135,798,419.27 | 93.87 |
| | 其中：股票 | 1,135,798,419.27 | 93.87 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 59,661,762.11 | 4.93 |
| | 其中：债券 | 59,661,762.11 | 4.93 |
| | 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 | 999,960.55 | 0.08 |
| | 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 | 13,081,567.82 | 1.08 |
| 8 | 其他资产 | 425,419.29 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 1,209,967,129.04 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 10,625,037.28 | 0.88 |
| B | 采矿业 | 54,451,295.07 | 4.51 |
| C | 制造业 | 594,821,663.37 | 49.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水 生产和供应业 | 43,523,799.09 | 3.61 |
| E | 建筑业 | 23,101,318.80 | 1.91 |
| F | 批发和零售业 | 2,959,888.00 | 0.25 |
| G | 交通运输、仓储和邮政 业 | 39,837,890.80 | 3.30 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|------------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 53,676,814.77 | 4.45 |
| J | 金融业 | 278,978,317.02 | 23.11 |
| K | 房地产业 | 9,694,630.00 | 0.80 |
| L | 租赁和商务服务业 | 9,541,437.67 | 0.79 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 10,615,199.02 | 0.88 |
| 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 | 3,402,692.75 | 0.28 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,135,229,983.64 | 94.03 |

5.2.2 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 | 407,933.25 | 0.03 |
| 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 | 31,864.80 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 117,489.02 | 0.01 |
| 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 | 11,148.56 | 0.00 |

| | | | |
|---|-------------------|------------|------|
| 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 | 568,435.63 | 0.05 |

5.2.3 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。

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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 | 600519 | 贵州茅台 | 34,548 | 52,651,152.00 | 4.36 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 145,498 | 38,702,468.00 | 3.21 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 912,296 | 35,853,232.80 | 2.97 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 610,321 | 32,133,400.65 | 2.66 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 269,276 | 20,254,940.72 | 1.68 |
| 6 | 600900 | 长江电力 | 673,701 | 19,907,864.55 | 1.65 |
| 7 | 300059 | 东方财富 | 730,756 | 18,868,119.92 | 1.56 |
| 8 | 601398 | 工商银行 | 2,478,000 | 17,147,760.00 | 1.42 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 564,785 | 16,474,778.45 | 1.36 |
| 10 | 000858 | 五粮液 | 106,916 | 14,972,516.64 | 1.24 |

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 301626 | 苏州天脉 | 957 | 62,951.46 | 0.01 |
| 2 | 688615 | 合合信息 | 289 | 47,910.42 | 0.00 |
| 3 | 301611 | 珂玛科技 | 804 | 45,104.40 | 0.00 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-------|-----------|------|
| 4 | 688449 | 联芸科技 | 1,406 | 41,392.64 | 0.00 |
| 5 | 688708 | 佳驰科技 | 780 | 38,181.00 | 0.00 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 59,661,762.11 | 4.94 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 59,661,762.11 | 4.94 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019740 | 24国债09 | 327,000 | 33,113,130.90 | 2.74 |
| 2 | 019706 | 23国债13 | 116,000 | 11,781,643.29 | 0.98 |
| 3 | 019733 | 24国债02 | 98,000 | 9,987,290.08 | 0.83 |
| 4 | 019631 | 20国债05 | 47,000 | 4,779,697.84 | 0.40 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末无股指期货投资。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

招商银行（代码：600036.SH）为本基金前十大持仓证券。2024年6月24日，据国家金融监督管理总局发布的行政处罚信息显示，招商银行股份有限公司因公司理财业务存在以下违法违规行为：一、未能有效穿透识别底层资产；二、信息披露不规范，国家金融监督管理总局处罚款350万元。

中信证券（代码：600030.SH）为本基金前十大持仓证券。2024年1月5日，据中国证券监督管理委员会发布的自律监管及纪律处分信息显示，中信证券股份有限公司因公司保荐的恒逸石化股份有限公司（发行人）可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上，中国证券监督管理委员会决定对公司采取出具警示函的监督管理措施。2024年4月30日，据深圳证券交易所发布的自律监管及纪律处分信息显示，中信证券股份有限公司因公司在尽职调查过程中，未按照《保荐人尽职调查工作准则》第七十条以及《监管规则适用指引-发行类第4号》4-11等执业规范要求，对发行人关联交易情况进行充分核查，导致招股说明书遗漏披露关联交易相关信息；在核查工作底稿已有记录的情况下，中信证券未充分关注并执行进一步的核查程序，在本所问询后仍未审慎核查，发表的核查意见不准确，深圳证券交易所决定对公司采取书面警示的自律监管措施，并出具监管函。2024年4月30日，据中国证券监督管理委员会发布的行政处罚信息显示，中信证券股份有限公司因涉嫌违反限制性规定转让股票，中国证券监督管理委员会决定对公司立案调查。2024年4月30日，据中国证券监督管理委员会发布的行政处罚信息显示，中信证券股份有限公司因涉嫌违反限制性规定转让股票，中国证券监督管理委员会责令公司改正违法行为，给予警告，没收违法所得1,910,680.83元，罚款合计23,250,000元。2024年5月7日，据中国证券监督管理委员会发布的自律监管及纪律处分信息显示，中信证券股份有限公司因公司在保荐江苏博涛智能热工股份有限公司首次公开发行股票并上市过程中，未勤勉尽责履行相关职责，对发行人存在内部控制制度未有效执行、财务会计核算不准确等问题的核查工作不到位，中国证券监督管理委员会决定对公司采取出具警示函的监督管理措施。2024年5月8日，据中国证券监督管理委员会广东监管局发布的自律监管及纪律处分信息显示，中信证券股份有限公司因一是对二甲苯贸易业务客户和供应商之间的关联关系核查不充分。二是对二甲苯贸易业务真实性核查不充分。三是对二甲苯业务单据审核中未关注到运输合同与船舱计量报告对应的船运公司存在明显差异。四是对二甲苯业务单据审核中未关注到销售合同和租船合同约定的装货港存在明显异常，中国证券监督管理委员会广东监管局决定对公司采取出具警示函的监督管理措施。2024年8月5日，据中国证券监督管理委员会贵州监管局发布的

自律监管及纪律处分信息显示，中信证券股份有限公司因公司保荐的贵州安达科技能源股份有限公司(以下简称安达科技)于2023年3月23日在北京证券交易所上市且选取的上市标准含净利润标准。安达科技2024年4月29日披露《2023年年度报告》，2023年度安达科技归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润为-63,392.83万元，上市当年即亏损，中国证券监督管理委员会贵州监管局决定对公司采取出具警示函的监督管理措施，并根据《证券期货市场诚信监督管理办法》(证监会令第166号)第七条、第八条规定记入证券期货市场诚信档案。2024年8月23日，据北京证券交易所有限责任公司发布的自律监管及纪律处分信息显示，中信证券股份有限公司因公司保荐的安达科技于2023年3月23日在北京证券交易所上市，且选取的上市标准含净利润标准。根据安达科技2024年4月29日披露的《2023年年度报告》，2023年度安达科技归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润为-63,392.83万元。安达科技在上市当年即发生亏损，北京证券交易所有限责任公司对公司采取出具警示函的自律监管措施；对于上述惩戒，北交所将记入证券期货市场诚信档案数据库。2024年11月8日，据深圳证券交易所发布的自律监管及纪律处分信息显示，中信证券股份有限公司因对发行人实际控制人认定和控制权稳定性的核查程序执行不到位、未督促发行人准确、完整披露控股股东的重大股权转让情况，深圳证券交易所决定对公司采取书面警示的监管措施。2024年12月20日，据中国证券监督管理委员会深圳监管局发布的自律监管及纪律处分信息显示，中信证券股份有限公司因经纪业务管理存在不足、场外衍生品业务管理存在不足，中国证券监督管理委员会深圳监管局决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 170,586.87 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 254,832.42 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 425,419.29 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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 | 301626 | 苏州天脉 | 62,951.46 | 0.01 | 创业板打新限售 |
| 2 | 688615 | 合合信息 | 47,910.42 | 0.00 | 科创板打新限售 |
| 3 | 301611 | 珂玛科技 | 45,104.40 | 0.00 | 创业板打新限售 |
| 4 | 688449 | 联芸科技 | 41,392.64 | 0.00 | 科创板打新限售 |
| 5 | 688708 | 佳驰科技 | 38,181.00 | 0.00 | 科创板打新限售 |

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 人保沪深300A | 人保沪深300C |
|-------------------------------|------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 676,555,829.41 | 916,374.28 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 508,640,227.20 | 50,133,054.94 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 173,615,768.73 | 3,661,199.53 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,011,580,287.88 | 47,388,229.69 |

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 20241001-20241112 | 199,514,322.49 | 0.00 | - | 199,514,322.49 | 18.84% |
| | 2 | 20241112-20241231 | 0.00 | 432,189,544.05 | - | 432,189,544.05 | 40.81% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予人保沪深300指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《人保沪深300指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《人保沪深300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、报告期内人保沪深300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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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

2025年01月21日