

# 人保中证 500 指数型证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 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:2025 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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月29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2025年01月01日起至2025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	11
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	12
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	13
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	13
§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	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	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§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.....	66
§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.....	67
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 .....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件 .....	69
§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 .....	71
§12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录 .....	71
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	40,741,935.63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	40,736,881.98份	5,053.65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		黄本尧	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	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 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	人保中证500A	人保中证500C
本期已实现收益	460,102.91	53.52
本期利润	2,777,175.04	2,476.19
加权平均基金份额本期利润	0.0608	0.2579
本期加权平均净值利润率	4.17%	17.93%
本期基金份额净值增长率	3.94%	1.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末可供分配利润	20,803,225.92	2,480.46
期末可供分配基金份额利润	0.5107	0.4908
期末基金资产净值	61,540,107.90	7,625.59
期末基金份额净值	1.5107	1.5089
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	51.07%	1.77%

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。

4、本基金自2025年2月28日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

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
过去一个月	4.78%	0.74%	4.09%	0.75%	0.69%	-0.01%
过去三个月	1.94%	1.40%	0.97%	1.43%	0.97%	-0.03%
过去六个月	3.94%	1.27%	3.21%	1.29%	0.73%	-0.02%
过去一年	19.17%	1.60%	18.83%	1.64%	0.34%	-0.04%
过去三年	-3.81%	1.26%	-7.61%	1.29%	3.80%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	51.07%	1.29%	33.27%	1.31%	17.80%	-0.02%

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
过去一个月	4.73%	0.73%	4.09%	0.75%	0.64%	-0.02%
过去三个月	1.84%	1.41%	0.97%	1.43%	0.87%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	1.77%	1.25%	-1.75%	1.31%	3.52%	-0.06%

注：本基金自2025年2月28日起增加C类份额。

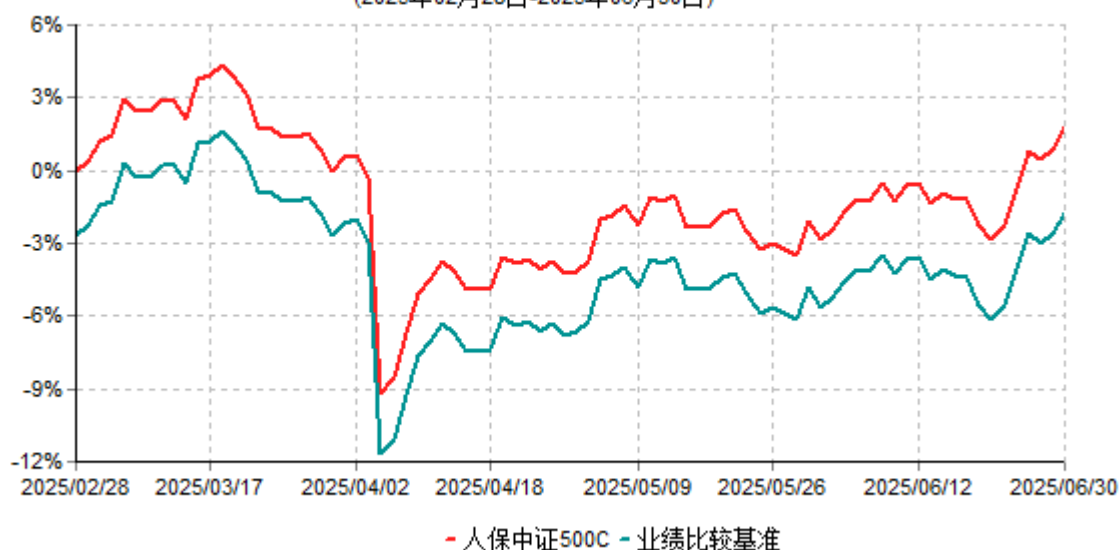
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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-2025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-2025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%。
- 3、本基金自2025年2月28日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

## §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1.9万亿元。

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2025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、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发起式基金中基金（FOF）、人保趋势优选混合型证券投资基金、人保泰和积极配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（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、人保民瑞30天滚动持有债券型证券投资基金、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	-	8.3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。

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遵规守信情况的说明

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500A基金份额净值为1.5107元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.94%，同期业绩比较基准收益率为3.21%；截至报告期末人保中证500C基金份额净值为1.5089元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.77%，同期业绩比较基准收益率为-1.75%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年一季度，我国经济增速录得5.4%，取得良好开端：一方面，在“扩内需”政策刺激推动下，商品消费展现出较大韧性，以《哪吒2》为代表的国产动画片取得创纪录票房并出口海外，人民精神文化消费逐步升温；另一方面，在抢出口带动下，上半年出口数据表现较为强劲；年初以来，新兴产业如机器人、人工智能、半导体、深海经济、低空经济等得到政策扶持，百花齐放。

然而，经济数据表现强劲背后也存在一些隐忧：例如房地产行业的低迷对于整体经济拖累仍在持续；低通胀折射出当下社会总需求恢复尚不牢固；海外来看，二季度以来由美国主导的关税贸易壁垒对于我国出口负面影响尚未显现；地缘冲突频发，俄乌冲突尚未结束，伊以再燃战火，国际大宗商品波动加剧。

对于我国资本市场而言，上半年行情虽经历一波三折，但整体走势仍为强劲。展望下半年，我国资本市场将受益于海外降息预期升温与国内较为宽松的货币政策支持；保险资金、企业年金、公募基金等为代表的中长期资金入市，也有望推动股市行稳致远。结构上看，五月证监会印发《推动公募基金高质量发展行动方案》，要求强化基金产品业绩比较基准的约束力，相较基准欠配过多行业有望得到结构性资金推动；以科技、红利为两端的哑铃策略或将表现出色。

#### 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：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,081,632.26	518,198.61
结算备付金		20,353.28	244,880.86
存出保证金		7,566.36	19,726.45
交易性金融资产	6.4.7.2	60,627,861.17	83,057,009.41
其中：股票投资		58,220,444.84	78,910,082.45
基金投资		-	-
债券投资		2,407,416.33	4,146,926.96
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	-	-
应收清算款		7,723.40	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,335.90	61,968.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		61,751,472.37	83,901,784.21
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年06月30日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		129,658.49	47,843.42
应付管理人报酬		22,311.89	33,046.13
应付托管费		4,958.19	7,343.59
应付销售服务费		2.18	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9.60	10.97
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	46,798.53	72,825.81
负债合计		203,738.88	161,069.92
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	40,741,935.63	57,612,697.73
未分配利润	6.4.7.8	20,805,797.86	26,128,016.56
净资产合计		61,547,733.49	83,740,714.29

负债和净资产总计		61,751,472.37	83,901,784.21
----------	--	---------------	---------------

注：1、报告截止日2025年06月30日，人保中证500A份额净值人民币1.5107元，基金份额总额40,736,881.98份；人保中证500C份额净值人民币1.5089元，基金份额总额5,053.65份；总份额合计40,741,935.63份；

2、本基金自2025年2月28日起增加C类份额。

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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		3,052,437.83	-5,328,556.08
1.利息收入		4,022.50	4,370.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,713.48	2,551.59
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		2,309.02	1,819.04
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		706,883.61	-16,256.73
其中：股票投资收益	6.4.7.10	142,025.56	-820,983.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	23,452.24	16,613.04
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	541,405.81	788,114.18



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	2,319,494.80	-5,318,404.04
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	22,036.92	1,734.06
减：二、营业总支出		272,786.60	244,825.61
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	149,846.15	93,449.25
2.托管费	6.4.10.2.2	33,299.15	20,766.47
3.销售服务费	6.4.10.2.3	19.19	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		73.59	168.09
其中：卖出回购金融资产支出		73.59	168.09
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		8.30	6.54
8.其他费用	6.4.7.19	89,540.22	130,435.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,779,651.23	-5,573,381.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,779,651.23	-5,573,381.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,779,651.23	-5,573,381.69

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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	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
项 目	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024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	25,558,786.18	9,521,400.56	35,080,186.74
二、本期期初净资产	25,558,786.18	9,521,400.56	35,080,186.74

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	28,311,051.52	4,897,005.96	33,208,057.48
（一）、综合收益总额	-	-5,573,381.69	-5,573,381.69
（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）	28,311,051.52	10,470,387.65	38,781,439.17
其中：1.基金申购款	31,782,227.44	11,557,733.63	43,339,961.07
2.基金赎回款	-3,471,175.92	-1,087,345.98	-4,558,521.90
（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	53,869,837.70	14,418,406.52	68,288,244.22

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，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。

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 $\times 95\%$  + 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2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	1,081,632.26
等于：本金	1,081,518.62
加：应计利息	113.64
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	1,081,632.26
----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		57,537,406.41	-	58,220,444.84	683,038.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,399,040.00	6,936.33	2,407,416.33	1,440.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,399,040.00	6,936.33	2,407,416.33	1,440.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		59,936,446.41	6,936.33	60,627,861.17	684,478.43

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 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	142.28
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,025.27
其中：交易所市场	2,025.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,630.98
合计	46,798.53

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 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,612,697.73	57,612,697.73
本期申购	3,174,415.19	3,174,415.19
本期赎回（以“-”号填列）	-20,050,230.94	-20,050,230.94
本期末	40,736,881.98	40,736,881.98

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 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	39,743.09	39,743.09
本期赎回（以“-”号填列）	-34,689.44	-34,689.44



本期末	5,053.65	5,053.65
-----	----------	----------

注：1、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。  
2、本基金自2025年2月28日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

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	65,193,973.19	-39,065,956.63	26,128,016.56
本期期初	65,193,973.19	-39,065,956.63	26,128,016.56
本期利润	460,102.91	2,317,072.13	2,777,175.04
本期基金份额交易产生的变动数	-19,138,102.95	11,036,137.27	-8,101,965.68
其中：基金申购款	3,598,366.55	-2,181,781.07	1,416,585.48
基金赎回款	-22,736,469.50	13,217,918.34	-9,518,551.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,515,973.15	-25,712,747.23	20,803,225.92

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	53.52	2,422.67	2,476.19
本期基金份额交易产生的变动数	2,426.94	-2,331.19	95.75
其中：基金申购款	19,220.24	-3,246.86	15,973.38
基金赎回款	-16,793.30	915.67	-15,877.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,480.46	91.48	2,571.94

注：本基金自2025年2月28日起增加C类份额，相关数据按实际存续期计算。

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	1,576.12
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	101.71
其他	35.65
合计	1,713.48

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	31,770,741.72
减：卖出股票成本总额	31,604,925.93
减：交易费用	23,790.23
买卖股票差价收入	142,025.56

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 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	23,242.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	209.90
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	23,452.24
----	-----------

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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,179,361.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,121,996.62
减：应计利息总额	57,153.87
减：交易费用	0.89
买卖债券差价收入	209.90

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 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	541,405.81
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	541,405.81

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	2,319,494.80
——股票投资	2,323,028.18
——债券投资	-3,533.38
——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	2,319,494.80

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	22,036.92
合计	22,036.92

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
----	----

	2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	4,959.40
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,020.00
其他费用_指数使用费	43,889.24
合计	89,540.22

**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 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	149,846.15	93,449.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	44,065.02	34,117.95
应支付基金管理人的净管理费	105,781.13	59,331.30

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 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	33,299.15	20,766.47

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		
	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，无去年同期数据。

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

人保中证500A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年06月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国人民健康保险股份有限公司	20,265,357.82	49.75%	20,265,357.82	35.18%

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资人保中证500C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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	1,081,632.26	1,576.12	564,053.68	2,049.48

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（2025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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	*ST中天	2023-05-19	摘牌	-	-	-	27,500	55,512.90	-	-

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 2025年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,081,632.26	-	-	-	1,081,632.26
结算备付金	20,353.28	-	-	-	20,353.28
存出保证金	7,566.36	-	-	-	7,566.36
交易性金融资产	2,407,416.33	-	-	58,220,444.84	60,627,861.17
应收清算款	-	-	-	7,723.40	7,723.40
应收申购款	-	-	-	6,335.90	6,335.90
资产总计	3,516,968.23	-	-	58,234,504.14	61,751,472.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	129,658.49	129,658.49
应付管	-	-	-	22,311.89	22,311.89

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	4,958.19	4,958.19
应付销售服务费	-	-	-	2.18	2.18
应交税费	-	-	-	9.60	9.60
其他负债	-	-	-	46,798.53	46,798.53
负债总计	-	-	-	203,738.88	203,738.88
利率敏感度缺口	3,516,968.23	-	-	58,030,765.26	61,547,733.49
上年度末 2024年12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	518,198.61	-	-	-	518,198.61
结算备付金	244,880.86	-	-	-	244,880.86
存出保证金	19,726.45	-	-	-	19,726.45
交易性金融资产	4,146,926.96	-	-	78,910,082.45	83,057,009.41
应收申购款	-	-	-	61,968.88	61,968.88
资产总计	4,929,732.88	-	-	78,972,051.33	83,901,784.21
负债					
应付赎回	-	-	-	47,843.42	47,843.42

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	33,046.13	33,046.13
应付托管费	-	-	-	7,343.59	7,343.59
应交税费	-	-	-	10.97	10.97
其他负债	-	-	-	72,825.81	72,825.81
负债总计	-	-	-	161,069.92	161,069.92
利率敏感度缺口	4,929,732.88	-	-	78,810,981.41	83,740,714.29

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	1. 市场利率上升25个基点	-4,692.49	-3,846.83
	2. 市场利率下降25个基点	4,713.28	3,860.24

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 2025年06月30日		上年度末 2024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	58,220,444.84	94.59	78,910,082.45	94.23
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	58,220,444.84	94.59	78,910,082.45	94.23

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	1. 业绩比较基准增加5%	2,989,807.64	3,174,005.67
	2. 业绩比较基准减少5%	-2,989,807.64	-3,174,005.67

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	58,220,444.84	78,910,082.45
第二层次	2,407,416.33	4,146,926.96
第三层次	-	-
合计	60,627,861.17	83,057,009.41

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；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。



6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年6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	58,220,444.84	94.28
	其中：股票	58,220,444.84	94.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,407,416.33	3.90
	其中：债券	2,407,416.33	3.90
	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	1,101,985.54	1.78
8	其他各项资产	21,625.66	0.04
9	合计	61,751,472.37	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	146,386.00	0.24
B	采矿业	2,093,972.70	3.40
C	制造业	36,672,872.71	59.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,858,929.00	3.02
E	建筑业	513,996.00	0.84
F	批发和零售业	1,282,730.60	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	958,572.00	1.56
H	住宿和餐饮业	155,955.60	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,397,126.39	8.77
J	金融业	5,729,406.42	9.31
K	房地产业	725,074.00	1.18
L	租赁和商务服务业	506,962.80	0.82
M	科学研究和技术服务业	395,194.00	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	245,442.08	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	120,258.00	0.20
Q	卫生和社会工作	267,957.36	0.44
R	文化、体育和娱乐业	827,239.18	1.34
S	综合	139,560.00	0.23
	合计	58,037,634.84	94.30

**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	108,061.00	0.18
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	16,425.00	0.03
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	30,229.00	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,335.00	0.03
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	11,760.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	182,810.00	0.30

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	300476	胜宏科技	4,700	631,586.00	1.03
2	603129	春风动力	1,700	368,050.00	0.60
3	000988	华工科技	7,800	366,678.00	0.60
4	600988	赤峰黄金	13,200	328,416.00	0.53
5	300339	润和软件	6,300	320,229.00	0.52
6	002958	青农商行	87,300	315,153.00	0.51
7	002966	苏州银行	34,810	305,631.80	0.50
8	600839	四川长虹	29,429	286,049.88	0.46
9	688235	百济神州	1,200	280,368.00	0.46
10	601555	东吴证券	31,660	277,025.00	0.45
11	601162	天风证券	55,200	272,136.00	0.44
12	688521	芯原股份	2,800	270,200.00	0.44
13	002340	格林美	40,800	259,080.00	0.42
14	002517	恺英网络	13,300	256,823.00	0.42
15	002195	岩山科技	45,250	254,757.50	0.41
16	002558	巨人网络	10,800	254,340.00	0.41
17	002261	拓维信息	8,000	247,600.00	0.40
18	603893	瑞芯微	1,600	242,976.00	0.39
19	600487	亨通光电	15,700	240,210.00	0.39
20	300251	光线传媒	11,700	237,159.00	0.39
21	600157	永泰能源	176,800	236,912.00	0.38
22	300207	欣旺达	11,800	236,708.00	0.38
23	002797	第一创业	33,400	236,472.00	0.38
24	000066	中国长城	15,400	227,920.00	0.37
25	300803	指南针	2,800	225,848.00	0.37
26	688213	思特威	2,200	224,884.00	0.37
27	688777	中控技术	5,000	224,550.00	0.36
28	600096	云天化	10,200	224,094.00	0.36
29	600536	中国软件	4,761	222,671.97	0.36
30	002273	水晶光电	11,098	221,627.06	0.36

31	601168	西部矿业	13,300	221,179.00	0.36
32	002465	海格通信	15,800	220,252.00	0.36
33	600879	航天电子	21,000	219,870.00	0.36
34	002156	通富微电	8,500	217,770.00	0.35
35	300450	先导智能	8,700	216,195.00	0.35
36	601099	太平洋	54,300	213,399.00	0.35
37	000831	中国稀土	5,900	213,108.00	0.35
38	600352	浙江龙盛	20,700	210,312.00	0.34
39	688608	恒玄科技	600	208,788.00	0.34
40	002294	信立泰	4,400	208,252.00	0.34
41	000933	神火股份	12,500	208,000.00	0.34
42	300017	网宿科技	19,400	207,968.00	0.34
43	600885	宏发股份	9,268	206,769.08	0.34
44	002185	华天科技	20,400	206,040.00	0.33
45	601108	财通证券	25,900	204,869.00	0.33
46	688617	惠泰医疗	682	202,554.00	0.33
47	688002	睿创微纳	2,900	202,188.00	0.33
48	600079	人福医药	9,100	190,918.00	0.31
49	601577	长沙银行	19,200	190,848.00	0.31
50	002130	沃尔核材	8,000	190,560.00	0.31
51	300454	深信服	2,000	188,360.00	0.31
52	000423	东阿阿胶	3,600	188,280.00	0.31
53	002085	万丰奥威	11,800	187,502.00	0.30
54	002281	光迅科技	3,800	187,416.00	0.30
55	300223	北京君正	2,700	186,840.00	0.30
56	688122	西部超导	3,600	186,768.00	0.30
57	000997	新大陆	5,750	186,185.00	0.30
58	002738	中矿资源	5,760	185,241.60	0.30
59	300058	蓝色光标	28,180	184,860.80	0.30
60	688099	晶晨股份	2,600	184,626.00	0.30
61	002532	天山铝业	22,200	184,482.00	0.30

62	688072	拓荆科技	1,200	184,452.00	0.30
63	300002	神州泰岳	15,600	184,080.00	0.30
64	688120	华海清科	1,090	183,883.00	0.30
65	002595	豪迈科技	3,100	183,582.00	0.30
66	000783	长江证券	26,400	182,952.00	0.30
67	300458	全志科技	4,600	182,574.00	0.30
68	600109	国金证券	20,700	181,539.00	0.29
69	002472	双环传动	5,400	180,846.00	0.29
70	002138	顺络电子	6,400	179,968.00	0.29
71	002078	太阳纸业	13,300	179,018.00	0.29
72	300474	景嘉微	2,450	178,850.00	0.29
73	002436	兴森科技	13,400	177,416.00	0.29
74	603596	伯特利	3,360	177,038.40	0.29
75	601933	永辉超市	36,100	176,890.00	0.29
76	300765	新诺威	3,400	175,746.00	0.29
77	002410	广联达	13,100	175,671.00	0.29
78	002851	麦格米特	3,500	175,490.00	0.29
79	600862	中航高科	6,700	174,736.00	0.28
80	300346	南大光电	5,500	174,020.00	0.28
81	600143	金发科技	16,800	173,208.00	0.28
82	600580	卧龙电驱	8,760	173,185.20	0.28
83	300136	信维通信	7,700	172,480.00	0.28
84	300054	鼎龙股份	6,000	172,080.00	0.28
85	002065	东华软件	17,900	171,840.00	0.28
86	300024	机器人	10,000	171,800.00	0.28
87	601198	东兴证券	15,400	171,710.00	0.28
88	002353	杰瑞股份	4,900	171,500.00	0.28
89	603606	东方电缆	3,300	170,643.00	0.28
90	600873	梅花生物	15,900	169,971.00	0.28
91	002850	科达利	1,500	169,755.00	0.28
92	000034	神州数码	4,500	169,380.00	0.28

93	600363	联创光电	2,900	169,157.00	0.27
94	002202	金风科技	16,500	169,125.00	0.27
95	002223	鱼跃医疗	4,750	169,100.00	0.27
96	600298	安琪酵母	4,800	168,816.00	0.27
97	300395	菲利华	3,300	168,630.00	0.27
98	002673	西部证券	21,300	167,844.00	0.27
99	688578	艾力斯	1,800	167,472.00	0.27
100	601615	明阳智能	14,500	166,605.00	0.27
101	300496	中科创达	2,900	165,938.00	0.27
102	000728	国元证券	20,800	164,112.00	0.27
103	002624	完美世界	10,800	163,836.00	0.27
104	300857	协创数据	1,900	163,514.00	0.27
105	002008	大族激光	6,700	163,279.00	0.27
106	300383	光环新网	11,400	163,020.00	0.26
107	688469	芯联集成	33,800	161,226.00	0.26
108	300115	长盈精密	7,500	160,500.00	0.26
109	603659	璞泰来	8,500	159,630.00	0.26
110	600895	张江高科	6,200	159,340.00	0.26
111	600549	厦门钨业	7,600	158,992.00	0.26
112	603087	甘李药业	2,900	158,862.00	0.26
113	300604	长川科技	3,500	157,185.00	0.26
114	300012	华测检测	13,400	156,646.00	0.25
115	688220	翱捷科技	2,000	156,600.00	0.25
116	000426	兴业银锡	9,900	156,420.00	0.25
117	603160	汇顶科技	2,200	156,266.00	0.25
118	002155	湖南黄金	8,742	156,044.70	0.25
119	000733	振华科技	3,100	155,155.00	0.25
120	600171	上海贝岭	4,500	154,125.00	0.25
121	300627	华测导航	4,340	151,900.00	0.25
122	605589	圣泉集团	5,400	149,850.00	0.24
123	603605	珀莱雅	1,800	149,022.00	0.24

124	601216	君正集团	26,900	148,488.00	0.24
125	688525	佰维存储	2,200	148,280.00	0.24
126	300037	新宙邦	4,200	147,840.00	0.24
127	600392	盛和资源	11,200	147,504.00	0.24
128	000750	国海证券	35,600	146,672.00	0.24
129	000519	中兵红箭	6,700	146,663.00	0.24
130	300699	光威复材	4,620	146,315.40	0.24
131	600153	建发股份	14,100	146,217.00	0.24
132	601665	齐鲁银行	23,100	145,992.00	0.24
133	002444	巨星科技	5,700	145,407.00	0.24
134	601997	贵阳银行	23,300	145,392.00	0.24
135	000932	华菱钢铁	32,980	145,112.00	0.24
136	000729	燕京啤酒	11,200	144,816.00	0.24
137	300003	乐普医疗	10,500	144,690.00	0.24
138	603529	爱玛科技	4,200	144,480.00	0.23
139	601717	郑煤机	8,600	142,932.00	0.23
140	600060	海信视像	6,200	142,724.00	0.23
141	688180	君实生物	4,200	142,716.00	0.23
142	000878	云南铜业	11,209	142,578.48	0.23
143	601990	南京证券	17,600	142,208.00	0.23
144	601696	中银证券	13,300	142,177.00	0.23
145	601233	桐昆股份	13,400	142,040.00	0.23
146	300001	特锐德	5,900	141,423.00	0.23
147	002821	凯莱英	1,600	141,200.00	0.23
148	000021	深科技	7,500	140,550.00	0.23
149	300073	当升科技	3,200	140,384.00	0.23
150	300142	沃森生物	12,700	139,700.00	0.23
151	600673	东阳光	12,000	139,560.00	0.23
152	002414	高德红外	13,600	139,400.00	0.23
153	603979	金诚信	3,000	139,320.00	0.23
154	600369	西南证券	31,700	137,895.00	0.22



155	600699	均胜电子	7,840	136,729.60	0.22
156	002837	英维克	4,600	136,666.00	0.22
157	002007	华兰生物	8,700	136,329.00	0.22
158	300373	扬杰科技	2,600	134,940.00	0.22
159	688361	中科飞测	1,600	134,704.00	0.22
160	600177	雅戈尔	18,400	134,320.00	0.22
161	600118	中国卫星	4,700	134,279.00	0.22
162	002152	广电运通	9,900	133,056.00	0.22
163	600398	海澜之家	19,100	132,936.00	0.22
164	000893	亚钾国际	4,400	132,616.00	0.22
165	688065	凯赛生物	2,800	131,880.00	0.21
166	600435	北方导航	8,402	130,987.18	0.21
167	000738	航发控制	6,300	130,725.00	0.21
168	600909	华安证券	22,420	130,708.60	0.21
169	600704	物产中大	24,800	130,696.00	0.21
170	600521	华海药业	7,000	130,410.00	0.21
171	688052	纳芯微	746	130,169.54	0.21
172	688249	晶合集成	6,400	129,728.00	0.21
173	300748	金力永磁	5,440	129,689.60	0.21
174	000623	吉林敖东	7,618	129,125.10	0.21
175	603345	安井食品	1,600	128,672.00	0.21
176	600497	驰宏锌锗	24,300	128,547.00	0.21
177	600316	洪都航空	3,400	128,180.00	0.21
178	688385	复旦微电	2,600	128,102.00	0.21
179	002044	美年健康	24,900	127,986.00	0.21
180	000009	中国宝安	14,300	126,984.00	0.21
181	603179	新泉股份	2,700	126,819.00	0.21
182	002318	久立特材	5,400	126,306.00	0.21
183	600765	中航重机	7,480	126,262.40	0.21
184	600562	国睿科技	4,000	125,960.00	0.20
185	002409	雅克科技	2,300	125,787.00	0.20

186	600141	兴发集团	6,100	125,233.00	0.20
187	000400	许继电气	5,700	124,089.00	0.20
188	600155	华创云信	17,747	123,519.12	0.20
189	001696	宗申动力	5,500	123,475.00	0.20
190	603228	景旺电子	2,947	123,302.48	0.20
191	002683	广东宏大	3,600	122,184.00	0.20
192	300919	中伟股份	3,700	121,656.00	0.20
193	000528	柳 工	12,600	121,086.00	0.20
194	000960	锡业股份	7,900	120,870.00	0.20
195	600637	东方明珠	16,100	120,267.00	0.20
196	002607	中公教育	39,300	120,258.00	0.20
197	300757	罗博特科	800	119,976.00	0.19
198	600498	烽火通信	5,700	119,871.00	0.19
199	300724	捷佳伟创	2,200	119,460.00	0.19
200	002739	万达电影	10,400	118,872.00	0.19
201	603939	益丰药房	4,852	118,728.44	0.19
202	600884	杉杉股份	12,500	118,250.00	0.19
203	600529	山东药玻	5,300	117,342.00	0.19
204	300623	捷捷微电	3,900	116,220.00	0.19
205	300558	贝达药业	2,000	115,900.00	0.19
206	688568	中科星图	3,200	115,232.00	0.19
207	000039	中集集团	14,620	114,913.20	0.19
208	000415	渤海租赁	34,500	114,885.00	0.19
209	002841	视源股份	3,300	114,180.00	0.19
210	002653	海思科	2,700	113,994.00	0.19
211	002025	航天电器	2,200	113,102.00	0.18
212	301358	湖南裕能	3,600	112,284.00	0.18
213	600486	扬农化工	1,930	111,940.00	0.18
214	002926	华西证券	12,500	111,750.00	0.18
215	600901	江苏金租	18,420	111,625.20	0.18
216	002385	大北农	27,500	111,100.00	0.18

217	000887	中鼎股份	6,270	110,289.30	0.18
218	688027	国盾量子	400	110,004.00	0.18
219	300285	国瓷材料	6,300	109,305.00	0.18
220	688188	柏楚电子	829	109,146.14	0.18
221	600563	法拉电子	1,000	109,090.00	0.18
222	300763	锦浪科技	1,900	109,041.00	0.18
223	300679	电连技术	2,400	108,912.00	0.18
224	002568	百润股份	4,200	107,562.00	0.17
225	688582	芯动联科	1,600	107,520.00	0.17
226	002939	长城证券	12,800	107,264.00	0.17
227	300144	宋城演艺	12,500	106,875.00	0.17
228	600863	内蒙华电	26,000	106,860.00	0.17
229	600820	隧道股份	17,500	106,750.00	0.17
230	600008	首创环保	35,100	106,002.00	0.17
231	603486	科沃斯	1,800	104,814.00	0.17
232	600132	重庆啤酒	1,900	104,690.00	0.17
233	002064	华峰化学	15,800	104,438.00	0.17
234	600390	五矿资本	17,900	104,357.00	0.17
235	000723	美锦能源	24,100	104,112.00	0.17
236	600516	方大炭素	22,400	103,936.00	0.17
237	603568	伟明环保	5,426	103,528.08	0.17
238	002080	中材科技	5,300	103,350.00	0.17
239	002312	川发龙蟒	9,000	103,320.00	0.17
240	600998	九州通	20,074	103,180.36	0.17
241	000703	恒逸石化	17,500	102,900.00	0.17
242	600166	福田汽车	37,800	102,438.00	0.17
243	688183	生益电子	2,000	102,400.00	0.17
244	002262	恩华药业	4,900	101,822.00	0.17
245	600763	通策医疗	2,462	101,631.36	0.17
246	600170	上海建工	42,400	101,336.00	0.16
247	603589	口子窖	2,900	100,920.00	0.16

248	000513	丽珠集团	2,800	100,912.00	0.16
249	600038	中直股份	2,600	100,906.00	0.16
250	300487	蓝晓科技	2,000	100,600.00	0.16
251	600208	衢州发展	33,900	100,344.00	0.16
252	605358	立昂微	4,300	100,190.00	0.16
253	601179	中国西电	16,300	100,082.00	0.16
254	600312	平高电气	6,500	100,035.00	0.16
255	688017	绿的谐波	800	99,912.00	0.16
256	002500	山西证券	17,100	99,864.00	0.16
257	000683	博源化工	20,800	99,632.00	0.16
258	300676	华大基因	2,000	99,540.00	0.16
259	603816	顾家家居	3,900	99,528.00	0.16
260	600380	健康元	9,000	99,270.00	0.16
261	688114	华大智造	1,528	99,060.24	0.16
262	601155	新城控股	7,200	98,496.00	0.16
263	600021	上海电力	11,200	98,448.00	0.16
264	002203	海亮股份	9,507	98,112.24	0.16
265	600985	淮北矿业	8,600	97,524.00	0.16
266	600126	杭钢股份	10,800	97,200.00	0.16
267	002244	滨江集团	9,900	96,525.00	0.16
268	600583	海油工程	17,600	96,096.00	0.16
269	601000	唐山港	23,600	95,816.00	0.16
270	000591	太阳能	21,800	95,702.00	0.16
271	600348	华阳股份	14,350	95,571.00	0.16
272	688728	格科微	6,200	95,480.00	0.16
273	000060	中金岭南	20,800	95,264.00	0.15
274	000921	海信家电	3,700	95,090.00	0.15
275	600872	中炬高新	5,000	95,000.00	0.15
276	603338	浙江鼎力	2,000	94,800.00	0.15
277	000629	钒钛股份	37,000	94,720.00	0.15
278	002432	九安医疗	2,600	94,718.00	0.15

279	603885	吉祥航空	7,000	94,290.00	0.15
280	601991	大唐发电	29,600	93,832.00	0.15
281	000830	鲁西化工	9,100	93,730.00	0.15
282	002603	以岭药业	6,600	93,060.00	0.15
283	002439	启明星辰	5,800	92,742.00	0.15
284	603379	三美股份	1,920	92,390.40	0.15
285	600816	建元信托	31,300	92,335.00	0.15
285	600535	天士力	5,900	92,335.00	0.15
286	002056	横店东磁	6,500	91,975.00	0.15
287	002984	森麒麟	4,900	91,875.00	0.15
288	600095	湘财股份	9,100	91,273.00	0.15
289	300146	汤臣倍健	8,100	91,044.00	0.15
290	300567	精测电子	1,500	90,915.00	0.15
291	600499	科达制造	9,200	90,160.00	0.15
292	600970	中材国际	10,500	90,090.00	0.15
293	603927	中科软	4,656	90,047.04	0.15
294	600685	中船防务	3,300	89,727.00	0.15
295	601880	辽港股份	59,700	89,550.00	0.15
296	601016	节能风电	30,900	89,301.00	0.15
297	002423	中粮资本	7,300	89,279.00	0.15
298	603000	人民网	4,400	88,924.00	0.14
299	000062	深圳华强	3,300	88,638.00	0.14
300	000958	电投产融	12,900	88,236.00	0.14
301	601611	中国核建	9,600	88,224.00	0.14
302	300390	天华新能	4,620	88,103.40	0.14
303	603298	杭叉集团	4,200	87,990.00	0.14
304	000636	风华高科	6,400	87,936.00	0.14
305	600859	王府井	6,300	87,507.00	0.14
306	301308	江波龙	1,000	87,490.00	0.14
307	600511	国药股份	3,000	87,480.00	0.14
308	601666	平煤股份	11,800	87,438.00	0.14

309	000563	陕国投 A	24,400	87,108.00	0.14
310	300212	易华录	4,000	87,040.00	0.14
311	688278	特宝生物	1,200	86,532.00	0.14
312	603077	和邦生物	49,200	86,100.00	0.14
313	600655	豫园股份	15,500	86,025.00	0.14
314	601456	国联民生	8,300	85,905.00	0.14
315	000598	兴蓉环境	11,900	85,799.00	0.14
316	600483	福能股份	8,900	85,796.00	0.14
317	688520	神州细胞	1,431	85,645.35	0.14
318	603737	三棵树	2,324	85,639.40	0.14
319	600004	白云机场	9,400	85,540.00	0.14
320	300677	英科医疗	3,600	85,248.00	0.14
321	600325	华发股份	17,500	85,225.00	0.14
322	601966	玲珑轮胎	5,800	85,086.00	0.14
323	600131	国网信通	4,800	84,960.00	0.14
324	603156	养元饮品	4,000	84,640.00	0.14
325	601958	金钼股份	7,700	84,238.00	0.14
326	603899	晨光股份	2,900	84,071.00	0.14
327	002773	康弘药业	2,900	84,013.00	0.14
328	600378	昊华科技	3,100	83,917.00	0.14
329	000050	深天马 A	9,800	83,496.00	0.14
330	600663	陆家嘴	9,400	83,284.00	0.14
331	000403	派林生物	4,580	83,035.40	0.13
332	000951	中国重汽	4,700	82,626.00	0.13
333	002756	永兴材料	2,600	82,550.00	0.13
334	002507	涪陵榨菜	6,450	82,495.50	0.13
335	600282	南钢股份	19,600	82,320.00	0.13
336	000987	越秀资本	11,985	82,217.10	0.13
337	600598	北大荒	5,700	82,194.00	0.13
338	300529	健帆生物	3,800	81,966.00	0.13
339	601001	晋控煤业	6,700	81,874.00	0.13

340	688297	中无人机	1,527	81,541.80	0.13
341	600271	航天信息	8,800	81,312.00	0.13
342	600754	锦江酒店	3,600	80,784.00	0.13
343	300601	康泰生物	5,300	80,507.00	0.13
344	600737	中粮糖业	8,500	80,325.00	0.13
345	600739	辽宁成大	7,300	80,300.00	0.13
346	000559	万向钱潮	10,483	80,194.95	0.13
347	601918	新集能源	12,400	80,104.00	0.13
348	600582	天地科技	13,200	79,068.00	0.13
349	002429	兆驰股份	18,000	78,840.00	0.13
350	003031	中瓷电子	1,480	78,750.80	0.13
351	301536	星宸科技	1,300	78,390.00	0.13
352	600764	中国海防	2,300	78,200.00	0.13
353	601333	广深铁路	27,000	78,030.00	0.13
354	300070	碧水源	17,300	77,850.00	0.13
355	300735	光弘科技	3,100	77,810.00	0.13
356	601866	中远海发	31,500	77,805.00	0.13
357	688538	和辉光电	33,076	77,397.84	0.13
358	688772	珠海冠宇	5,402	77,194.58	0.13
359	002120	韵达股份	11,500	77,050.00	0.13
360	600329	达仁堂	2,300	76,728.00	0.12
361	300751	迈为股份	1,100	76,516.00	0.12
362	600566	济川药业	2,900	76,357.00	0.12
363	688234	天岳先进	1,300	76,115.00	0.12
364	601231	环旭电子	5,200	76,076.00	0.12
365	002430	杭氧股份	3,900	75,738.00	0.12
366	603688	石英股份	2,150	75,723.00	0.12
367	600867	通化东宝	9,200	75,440.00	0.12
368	600258	首旅酒店	5,320	75,171.60	0.12
369	300888	稳健医疗	1,820	74,802.00	0.12
370	688561	奇安信	2,200	74,756.00	0.12

371	603728	鸣志电器	1,300	74,711.00	0.12
372	601098	中南传媒	5,690	74,652.80	0.12
373	600995	南网储能	7,600	74,328.00	0.12
374	688301	奕瑞科技	847	74,205.67	0.12
375	601212	白银有色	23,600	73,868.00	0.12
376	600707	彩虹股份	11,400	73,644.00	0.12
377	603290	斯达半导	900	73,143.00	0.12
378	603341	龙旗科技	1,800	73,134.00	0.12
379	000032	深桑达 A	3,600	72,828.00	0.12
380	688778	厦钨新能	1,300	72,696.00	0.12
381	002508	老板电器	3,800	72,238.00	0.12
382	000027	深圳能源	11,320	72,221.60	0.12
383	688363	华熙生物	1,400	71,890.00	0.12
384	600578	京能电力	16,000	71,840.00	0.12
385	000155	川能动力	7,300	71,686.00	0.12
386	603858	步长制药	4,400	71,456.00	0.12
387	000709	河钢股份	32,900	71,064.00	0.12
388	600906	财达证券	10,330	70,450.60	0.11
389	000967	盈峰环境	10,100	70,195.00	0.11
390	002299	圣农发展	4,900	70,021.00	0.11
391	002831	裕同科技	2,989	70,002.38	0.11
392	000883	湖北能源	15,500	69,905.00	0.11
393	600517	国网英大	13,700	69,870.00	0.11
394	300573	兴齐眼药	1,340	69,398.60	0.11
395	002670	国盛金控	4,600	69,230.00	0.11
396	601399	国机重装	23,000	69,000.00	0.11
397	600546	山煤国际	7,900	68,967.00	0.11
398	688318	财富趋势	600	68,952.00	0.11
399	600848	上海临港	7,600	68,932.00	0.11
400	600959	江苏有线	19,900	68,456.00	0.11
401	601928	凤凰传媒	6,100	68,137.00	0.11



402	601156	东航物流	5,100	66,759.00	0.11
403	600968	海油发展	16,200	66,096.00	0.11
404	600808	马钢股份	19,100	65,895.00	0.11
405	000739	普洛药业	4,700	65,800.00	0.11
406	300595	欧普康视	4,300	65,661.00	0.11
407	000825	太钢不锈	18,200	65,338.00	0.11
408	600528	中铁工业	8,800	64,944.00	0.11
409	002572	索菲亚	4,600	64,446.00	0.10
410	601118	海南橡胶	13,600	64,192.00	0.10
411	601636	旗滨集团	12,800	64,128.00	0.10
412	002266	浙富控股	20,800	64,064.00	0.10
413	603565	中谷物流	6,700	63,985.00	0.10
414	301301	川宁生物	5,300	63,812.00	0.10
415	601608	中信重工	14,583	63,727.71	0.10
416	600977	中国电影	5,900	63,248.00	0.10
417	600871	石化油服	32,400	63,180.00	0.10
418	000543	皖能电力	9,000	63,000.00	0.10
419	600801	华新水泥	5,300	62,752.00	0.10
420	601598	中国外运	12,500	61,625.00	0.10
421	600056	中国医药	5,920	61,212.80	0.10
422	603650	彤程新材	1,900	61,085.00	0.10
423	688702	盛科通信	1,000	61,080.00	0.10
424	601106	中国一重	21,800	61,040.00	0.10
425	688387	信科移动	10,800	61,020.00	0.10
426	000785	居然智家	20,000	61,000.00	0.10
427	600062	华润双鹤	3,260	60,831.60	0.10
428	688676	金盘科技	1,800	60,210.00	0.10
429	603233	大参林	3,600	58,680.00	0.10
430	600925	苏能股份	11,000	57,530.00	0.09
431	300957	贝泰妮	1,300	57,486.00	0.09
432	600373	中文传媒	5,594	57,450.38	0.09

433	601965	中国汽研	3,200	56,800.00	0.09
434	688563	航材股份	1,000	56,630.00	0.09
435	002153	石基信息	6,520	56,463.20	0.09
436	000429	粤高速 A	4,200	55,986.00	0.09
437	600606	绿地控股	33,600	54,768.00	0.09
438	002372	伟星新材	5,100	52,836.00	0.09
439	601568	北元集团	12,680	52,622.00	0.09
440	600098	广州发展	8,400	52,500.00	0.09
441	688425	铁建重工	12,800	52,224.00	0.08
442	001286	陕西能源	6,000	52,200.00	0.08
443	603225	新凤鸣	4,820	51,333.00	0.08
444	003022	联泓新科	3,200	50,656.00	0.08
445	600688	上海石化	17,500	49,875.00	0.08
446	600612	老凤祥	1,000	49,750.00	0.08
447	688349	三一重能	1,968	49,081.92	0.08
448	603658	安图生物	1,300	48,750.00	0.08
449	000937	冀中能源	8,400	48,300.00	0.08
450	601019	山东出版	5,000	47,350.00	0.08
451	688281	华秦科技	763	46,169.13	0.08
452	000582	北部湾港	5,400	44,550.00	0.07
453	688100	威胜信息	1,200	44,460.00	0.07
454	000898	鞍钢股份	19,000	44,080.00	0.07
455	002608	江苏国信	6,000	43,980.00	0.07
456	601139	深圳燃气	6,900	43,884.00	0.07
457	301498	乖宝宠物	400	43,748.00	0.07
458	600339	中油工程	13,300	43,491.00	0.07
459	600032	浙江新能	5,700	43,092.00	0.07
460	603707	健友股份	3,862	43,061.30	0.07
461	301165	锐捷网络	700	43,022.00	0.07
462	600720	中交设计	5,500	42,515.00	0.07
463	000959	首钢股份	12,400	42,160.00	0.07

464	688375	国博电子	694	41,646.94	0.07
465	600928	西安银行	10,600	41,552.00	0.07
466	003035	南网能源	9,000	41,310.00	0.07
467	000537	中绿电	4,940	41,298.40	0.07
468	600295	鄂尔多斯	4,700	40,937.00	0.07
469	688248	南网科技	1,300	40,898.00	0.07
470	603556	海兴电力	1,600	40,752.00	0.07
471	688032	禾迈股份	396	39,544.56	0.06
472	002461	珠江啤酒	3,500	39,515.00	0.06
473	688475	萤石网络	1,253	39,494.56	0.06
474	688172	燕东微	2,000	39,320.00	0.06
475	600361	创新新材	9,800	39,102.00	0.06
476	601228	广州港	12,000	38,760.00	0.06
477	301267	华夏眼科	2,000	38,340.00	0.06
478	600927	永安期货	2,300	34,063.00	0.06
479	601061	中信金属	4,300	34,013.00	0.06
480	002563	森马服饰	6,400	33,664.00	0.05
481	688295	中复神鹰	1,600	33,280.00	0.05
482	603786	科博达	600	33,246.00	0.05
483	600007	中国国贸	1,600	32,928.00	0.05
484	000539	粤电力 A	7,100	32,234.00	0.05
485	603826	坤彩科技	1,600	31,312.00	0.05
486	600299	安迪苏	3,200	30,880.00	0.05
487	300140	节能环保	4,900	30,233.00	0.05
488	002945	华林证券	2,100	30,177.00	0.05
489	688819	天能股份	1,048	29,092.48	0.05
490	001213	中铁特货	7,100	28,826.00	0.05
491	601921	浙版传媒	3,500	28,210.00	0.05
492	688153	唯捷创芯	900	27,909.00	0.05
493	601858	中国科传	1,300	25,285.00	0.04
494	601158	重庆水务	4,600	21,344.00	0.03

495	600956	新天绿能	2,400	18,528.00	0.03
496	001389	广合科技	300	17,631.00	0.03
497	603868	飞科电器	400	14,348.00	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	688369	致远互联	700	18,473.00	0.03
2	688768	容知日新	400	17,756.00	0.03
3	300833	浩洋股份	500	16,715.00	0.03
4	301376	致欧科技	900	16,425.00	0.03
5	300795	米奥会展	1,100	16,335.00	0.03
6	603730	岱美股份	2,700	15,363.00	0.02
7	688286	敏芯股份	200	14,138.00	0.02
8	603324	盛剑科技	500	12,700.00	0.02
9	301239	普瑞眼科	300	11,760.00	0.02
10	688246	嘉和美康	400	11,756.00	0.02
11	603558	健盛集团	1,200	10,932.00	0.02
12	301363	美好医疗	600	10,584.00	0.02
13	603408	建霖家居	900	9,873.00	0.02
14	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	688235	百济神州	304,235.55	0.36
2	302132	中航成飞	238,590.00	0.28

3	688608	恒玄科技	229,696.00	0.27
4	300251	光线传媒	216,333.00	0.26
5	000933	神火股份	211,662.00	0.25
6	300450	先导智能	191,109.00	0.23
7	002130	沃尔核材	180,944.00	0.22
8	300454	深信服	178,847.00	0.21
9	300458	全志科技	178,698.00	0.21
10	600363	联创光电	174,960.00	0.21
11	300346	南大光电	165,101.00	0.20
12	002851	麦格米特	161,424.00	0.19
13	300115	长盈精密	158,456.00	0.19
14	300857	协创数据	156,653.00	0.19
15	605589	圣泉集团	145,152.00	0.17
16	600171	上海贝岭	144,627.00	0.17
17	603659	璞泰来	141,461.00	0.17
18	002007	华兰生物	140,241.00	0.17
19	300627	华测导航	137,840.00	0.16
20	002837	英维克	124,456.00	0.15

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	600418	江淮汽车	829,801.00	0.99
2	002625	光启技术	676,898.00	0.81
3	002384	东山精密	490,488.00	0.59
4	301236	软通动力	370,320.00	0.44
5	300251	光线传媒	284,918.00	0.34
6	300866	安克创新	267,675.80	0.32

7	302132	中航成飞	265,678.00	0.32
8	002128	电投能源	237,141.00	0.28
9	688047	龙芯中科	225,375.06	0.27
10	600642	申能股份	195,330.17	0.23
11	601567	三星医疗	189,977.00	0.23
12	603129	春风动力	182,254.00	0.22
13	000988	华工科技	165,407.00	0.20
14	000818	航锦科技	159,124.00	0.19
15	002407	多氟多	158,715.00	0.19
16	300339	润和软件	157,515.00	0.19
17	603893	瑞芯微	153,013.00	0.18
18	002958	青农商行	147,247.00	0.18
19	600839	四川长虹	143,854.00	0.17
20	688536	思瑞浦	143,274.18	0.17

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	8,592,260.14
卖出股票收入（成交）总额	31,770,741.72

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	2,407,416.33	3.91
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	2,407,416.33	3.91

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	019773	25国债08	24,000	2,407,416.33	3.91

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

胜宏科技（代码：300476.SZ）为本基金前十大持仓证券。2024年11月30日，据中华人民共和国梅沙海关发布的行政处罚信息显示，胜宏科技(惠州)股份有限公司因货物报关时与申报不符，中华人民共和国梅沙海关处罚款4.96万元。

青农商行（代码：002958.SZ）为本基金前十大持仓证券。2025年6月3日，据中国人民银行青岛市分行(国家外汇管理局青岛市分局)发布的行政处罚信息显示，青岛农村

商业银行股份有限公司因存在提供虚假的或隐瞒重要事实的统计资料、未按规定报送撤销单位银行结算账户资料、未按规定挑剔不宜流通人民币等问题，中国人民银行青岛市分行(国家外汇管理局青岛市分局)给予警告，处罚款91.2万元。

赤峰黄金（代码：600988.SH）为本基金前十大持仓证券。2025年3月21日，据中国证券监督管理委员会内蒙古监管局发布的自律监管及纪律处分信息显示，赤峰吉隆黄金矿业股份有限公司因公司全资子公司吉林瀚丰矿业科技有限公司2023年一季度因生产设施改造停产两个月，公司未及时进行信息披露，迟至2023年4月30日在2023年第一季度报告中披露，中国证券监督管理委员会内蒙古监管局决定对公司采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。

苏州银行（代码：002966.SZ）为本基金前十大持仓证券。2024年7月31日，据国家金融监督管理总局江苏监管局发布的行政处罚信息显示，苏州银行股份有限公司因数据治理违反审慎经营规则，国家金融监督管理总局江苏监管局处罚款60万元。2025年4月9日，据中国证券监督管理委员会江苏监管局发布的自律监管及纪律处分信息显示，苏州银行股份有限公司因存在以下问题：一、人员管理方面，个别核心业务岗位人员不具备2年托管业务从业经验。二、估值核算方面，针对个别所托管基金估值对账不一致的情况，未及时处理并向基金管理人提示反馈。三、内部控制方面，内控稽核部同时承担投资监督和稽核管理职责;公司资产托管系统个别产品基本信息录入有误，中国证券监督管理委员会江苏监管局决定对公司采取出具警示函的监督管理措施。

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。

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	7,566.36
2	应收清算款	7,723.40
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,335.90
6	其他应收款	-



7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,625.66

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 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
人保 中证5 00A	3,791	10,745.68	20,265,357.82	49.75%	20,471,524.16	50.25%
人保 中证5 00C	10	505.37	0.00	0.00%	5,053.65	100.00%
合计	3,7	10,724.38	20,265,357.82	49.7	20,476,577.81	50.26%

	99			4%		
--	----	--	--	----	--	--

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500A	136,568.15	0.34%
	人保中证500C	674.49	13.35%
	合计	137,242.64	0.34%

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

§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	57,612,697.73	-
本报告期基金总申购份额	3,174,415.19	39,743.09
减：本报告期基金总赎回份额	20,050,230.94	34,689.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,736,881.98	5,053.65

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

报告期内，基金管理人、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	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	

	量					
长江证券	1	12,231,441.43	30.59%	1,661.78	30.58%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	7,497,728.59	18.75%	1,019.05	18.75%	-
招商证券	1	19,911,343.76	49.80%	2,706.14	49.80%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	345,065.00	0.86%	46.85	0.86%	-

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的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	1,003,399.66	29.33%	8,600,000.00	25.52%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	2,399,040.00	70.12%	22,800,000.00	67.66%	-	-	-	-
招商证券	18,809.70	0.55%	2,300,000.00	6.82%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	人保中证500指数型证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-21
2	公司旗下基金2024年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-01-21
3	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	2025-02-28
4	人保中证500指数型证券投资基金基金合同更新	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-28
5	人保中证500指数型证券投资基金托管协议更新	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-28
6	人保中证500指数型证券投资	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-28

	资基金招募说明书更新(2025年第1号)		
7	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	2025-02-28
8	中国人保资产管理有限公司关于旗下人保中证500指数型证券投资基金增设C类基金份额并修改基金合同与托管协议的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-02-28
9	人保中证500指数型证券投资基金更新的招募说明书（2025年第2号）	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-15
10	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	2025-03-15
11	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	2025-03-15
12	人保中证500指数型证券投资基金基金合同更新	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-19
13	关于中国人保资产管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-19
14	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	2025-03-22
15	人保中证500指数型证券投资基金招募说明书更新（2025年第3号）	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-22
16	关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-22
17	人保中证500指数型证券投	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-28

	资基金2024年年度报告		
18	公司旗下基金2024年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-03-28
19	人保中证500指数型证券投资基金2025年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-21
20	公司旗下基金2025年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025-04-21

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	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	20250101-20250630	20,265,357.82	-	-	20,265,357.82	49.74%
个人	1	20250101-20250218	15,511,393.57	-	15,511,393.57	-	-
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2025年3月21日起，本基金的指数使用费调整为基金管理人承担。

§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

二〇二五年八月三十日