

人保沪深 300 指数型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:中国人保资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
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	61
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	61
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	61
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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64

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.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	66
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	人保沪深300指数型证券投资基金	
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	
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	428,718,959.06份	
基金合同存续期	不定期	
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	388,994,605.72份	39,724,353.34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。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金中期报告置备地点	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	人保沪深300A	人保沪深300C
本期已实现收益	22,237,368.42	2,243,859.79
本期利润	50,610,351.71	5,140,260.62
加权平均基金份额本期利润	0.1250	0.1226
本期加权平均净值利润率	8.84%	8.44%
本期基金份额净值增长率	8.99%	8.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	165,624,610.16	5,320,606.97
期末可供分配基金份额利润	0.4258	0.1339
期末基金资产净值	582,460,076.19	61,051,851.05
期末基金份额净值	1.4973	1.5369
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	76.06%	48.29%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

人保沪深300A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	12.68%	1.18%	11.30%	1.19%	1.38%	-0.01%
过去六个月	8.99%	1.06%	7.20%	1.07%	1.79%	-0.01%
过去一年	29.84%	0.96%	25.13%	0.97%	4.71%	-0.01%
过去三年	41.35%	1.05%	28.26%	1.06%	13.09%	-0.01%
过去五年	9.15%	1.04%	-4.03%	1.06%	13.18%	-0.02%
过去七年	73.62%	1.09%	29.32%	1.11%	44.30%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	76.06%	1.10%	34.31%	1.13%	41.75%	-0.03%

人保沪深300C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	12.57%	1.18%	11.30%	1.19%	1.27%	-0.01%
过去六个月	8.78%	1.06%	7.20%	1.07%	1.58%	-0.01%
过去一年	29.33%	0.96%	25.13%	0.97%	4.20%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	48.29%	1.14%	38.71%	1.14%	9.58%	0.00%

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-2026年06月30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-2026年06月30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%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

成立二十多年来，人保资产以保险资金运用为主业，基于资产负债匹配管理理念，探索建立了从资产战略配置、资产战术配置、资产交易配置到集中交易和全流程风险管控的资产管理价值链，并着眼于构建能够获得持续稳定收益的资产组合，坚持以绝对收益为核心的收益缺口管理原则，为委托人贡献了长期稳定的投资收益。

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

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

人保资产于2017年1月11日获得中国证监会《关于核准中国人保资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]107号），于2017年3月29日获得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。截至2026年6月30日，本公司旗下基金产品线逐渐丰富，涵盖了股票指数型、债券型、混合型、货币型产品，管理的基金产品分别为人保货币市场基金、人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金、人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金、人保利丰纯债债券型证券投资基金、人保安睿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、人保民享利率债债券型证券投资基金、人保泰睿积极配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保泰和积极配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周剑	基金经理	2023-09-15	-	9.3年	华东理工大学金融学硕士，曾在中欧基金管理有限公司担任量化分析师、研究助理、研究员。2023年1月加入人保资产公募基金事业部，自2023年7月13日起任人保中证500指数型证券投资基金基金经理，2023年9月15日起担任人保沪深300指数型证券投资基金基金经理，2024年12月3日起任人保红利智享混合型证券投资基金基金经理，2025年12月16日起任人保中证500指数增强型证券投资基金基金经理，2026年3月23日起任人保中证港股通互联网指数型证券投资基金、人保睿逸智选混合型证券投资基金基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为本基金合同生效日。

2、非首任基金经理，其“任职日期”为公告确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

报告期内，基金管理人根据基金合同约定，以坚持被动指数化投资为原则进行基金的投资运作，并通过定量技术对基金跟踪误差进行监控及分析。报告期内基金跟踪误差来源主要是：1）标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票；2）基金的申购赎回；3）成份股票的停牌。

本基金作为一只跟踪沪深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。

4.4.2 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1.4973元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.99%，同期业绩比较基准收益率为7.20%；截至报告期末人保沪深300C基金份额净值为1.5369元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.78%，同期业绩比较基准收益率为7.20%。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值委员会，成员主要由公募基金事业部相关领导、投研、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，基金托管人在人保沪深300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沪深300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沪深300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：人保沪深300指数型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	25,949,038.77	7,586,422.82

结算备付金		245,928.00	276,196.82
存出保证金		34,020.81	114,645.97
交易性金融资产	6.4.7.2	612,574,735.48	664,055,715.67
其中：股票投资		603,144,314.55	633,752,822.52
基金投资		-	-
债券投资		9,430,420.93	30,302,893.15
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	3,500,000.00	2,799,237.26
应收清算款		2,346,073.21	516,676.68
应收股利		-	-
应收申购款		273,675.24	157,911.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		644,923,471.51	675,506,806.88
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,017,579.59	921,650.03
应付管理人报酬		233,674.52	264,993.62
应付托管费		51,927.68	58,887.46
应付销售服务费		19,855.43	20,601.67
应付投资顾问费		-	-

应交税费		111.80	80.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	88,395.25	165,422.68
负债合计		1,411,544.27	1,431,636.27
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	428,718,959.06	489,458,399.08
未分配利润	6.4.7.8	214,792,968.18	184,616,771.53
净资产合计		643,511,927.24	674,075,170.61
负债和净资产总计		644,923,471.51	675,506,806.88

注：报告截止日2026年06月30日，人保沪深300A份额净值人民币1.4973元，基金份额总额388,994,605.72份；人保沪深300C份额净值人民币1.5369元，基金份额总额39,724,353.34份；总份额合计428,718,959.06份。

6.2 利润表

会计主体：人保沪深300指数型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		57,675,446.77	13,291,132.40
1.利息收入		41,511.01	81,269.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,703.13	30,465.24
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		12,807.88	50,804.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		26,335,652.53	3,683,858.99

其中：股票投资收益	6.4.7.10	20,290,664.70	-8,705,222.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	185,758.48	232,502.67
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	5,859,229.35	12,156,578.73
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	31,269,384.12	9,386,533.78
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	28,899.11	139,470.06
减：二、营业总支出		1,924,834.44	3,268,246.64
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,412,406.41	2,496,718.19
2.托管费	6.4.10.2.2	313,868.10	554,826.29
3.销售服务费	6.4.10.2.3	120,716.54	94,637.23
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		269.46	421.65
其中：卖出回购金融资产 支出		269.46	421.65
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		46.10	182.96
8.其他费用	6.4.7.19	77,527.83	121,460.32
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		55,750,612.33	10,022,885.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		55,750,612.33	10,022,885.76

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		55,750,612.33	10,022,885.76

6.3 净资产变动表

会计主体：人保沪深300指数型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	489,458,399.08	184,616,771.53	674,075,170.61
二、本期期初净资产	489,458,399.08	184,616,771.53	674,075,170.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-60,739,440.02	30,176,196.65	-30,563,243.37
（一）、综合收益总额	-	55,750,612.33	55,750,612.33
（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）	-60,739,440.02	-25,574,415.68	-86,313,855.70
其中：1.基金申购款	28,172,807.53	11,776,310.44	39,949,117.97
2.基金赎回款	-88,912,247.55	-37,350,726.12	-126,262,973.67
（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	428,718,959.06	214,792,968.18	643,511,927.24
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,058,968,517.57	148,301,493.15	1,207,270,010.72
二、本期期初净资产	1,058,968,517.57	148,301,493.15	1,207,270,010.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-323,075,022.89	-34,097,208.87	-357,172,231.76
（一）、综合收益总额	-	10,022,885.76	10,022,885.76
（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）	-323,075,022.89	-44,120,094.63	-367,195,117.52
其中：1.基金申购款	71,358,087.97	9,342,999.20	80,701,087.17
2.基金赎回款	-394,433,110.86	-53,463,093.83	-447,896,204.69
（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	735,893,494.68	114,204,284.28	850,097,778.96

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

人保沪深300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》、《人保沪深300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]1695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205,770,647.89份，本基金的管理人为中国人保资产管理有限公司，托管人为交通银行股份有限公司。自2024年6月18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“人保沪深300A”），C类基金份额（以下简称“人保沪深300C”）两类份额。其中，人保沪深300A不收取销售服务费；人保沪深300C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，本基金的投资范围主要为标的指数成份股、备选成份股。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）、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：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；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：沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策

的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

b) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	25,949,038.77
等于：本金	25,946,397.95
加：应计利息	2,640.82
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	25,949,038.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		473,582,723.00	-	603,144,314.55	129,561,591.55
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,347,030.00	126,460.93	9,430,420.93	-43,070.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	9,347,030.00	126,460.93	9,430,420.93	-43,070.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		482,929,753.00	126,460.93	612,574,735.48	129,518,521.55

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无因买断式逆回购交易而取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	859.33
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	12,160.28
其中：交易所市场	12,160.28
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	75,375.64
合计	88,395.25

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 人保沪深300A

金额单位：人民币元

项目 (人保沪深300A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	446,652,435.02	446,652,435.02
本期申购	23,695,783.84	23,695,783.84
本期赎回（以“-”号填列）	-81,353,613.14	-81,353,613.14
本期末	388,994,605.72	388,994,605.72

6.4.7.7.2 人保沪深300C

金额单位：人民币元

项目 (人保沪深300C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,805,964.06	42,805,964.06
本期申购	4,477,023.69	4,477,023.69
本期赎回（以“-”号填列）	-7,558,634.41	-7,558,634.41
本期末	39,724,353.34	39,724,353.34

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 人保沪深300A

单位：人民币元

项目 (人保沪深300A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	165,597,062.44	1,347,574.85	166,944,637.29
本期期初	165,597,062.44	1,347,574.85	166,944,637.29
本期利润	22,237,368.42	28,372,983.29	50,610,351.71
本期基金份额交易产生的变动数	-22,209,820.70	-1,879,697.83	-24,089,518.53
其中：基金申购款	9,461,565.59	329,218.52	9,790,784.11
基金赎回款	-31,671,386.29	-2,208,916.35	-33,880,302.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	165,624,610.16	27,840,860.31	193,465,470.47

6.4.7.8.2 人保沪深300C

单位：人民币元

项目 (人保沪深300C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,436,403.33	14,235,730.91	17,672,134.24
本期期初	3,436,403.33	14,235,730.91	17,672,134.24
本期利润	2,243,859.79	2,896,400.83	5,140,260.62
本期基金份额交易产生的变动数	-359,656.15	-1,125,241.00	-1,484,897.15
其中：基金申购款	470,646.04	1,514,880.29	1,985,526.33
基金赎回款	-830,302.19	-2,640,121.29	-3,470,423.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,320,606.97	16,006,890.74	21,327,497.71

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	28,230.34
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	398.31
其他	74.48
合计	28,703.13

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	115,026,823.46
减：卖出股票成本总额	94,649,486.48
减：交易费用	86,672.28
买卖股票差价收入	20,290,664.70

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	172,958.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,800.00
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	185,758.48

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	30,409,247.95

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,987,700.00
减：应计利息总额	408,747.95
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	12,800.00

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,859,229.35
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	5,859,229.35

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	31,269,384.12
——股票投资	31,333,754.12
——债券投资	-64,370.00

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	31,269,384.12

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	28,494.71
转换费收入	404.40
合计	28,899.11

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	15,868.27
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,152.19
合计	77,527.83

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国人保资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国人民保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东
中国人保香港资产管理有限公司	基金管理人控股子公司
人保启元惠众（北京）私募基金管理有限公司	基金管理人控股子公司
深圳市保腾盛私募股权基金管理有限公司	基金管理人控股子公司
大成创新资本管理有限公司	基金管理人联营公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,412,406.41	2,496,718.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	183,522.67	273,110.56
应支付基金管理人的净管理费	1,228,883.74	2,223,607.63

注：支付基金管理人中国人保资产管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.45%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.45%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	313,868.10	554,826.29

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保沪深300A	人保沪深300C	合计
中国人保 资产管理 有限公司	0.00	105,331.81	105,331.81
合计	0.00	105,331.81	105,331.81
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保沪深300A	人保沪深300C	合计
中国人保 资产管理 有限公司	0.00	57,208.93	57,208.93
合计	0.00	57,208.93	57,208.93

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额：A类基金份额不收取销售服务费；C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值×0.40%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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	25,949,038.77	28,230.34	117,618,797.48	28,366.79

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301666	大普微	2026-04-08	6个月	创业板打新限售	46.08	463.33	984	45,342.72	455,916.72	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	943	18,558.24	133,425.07	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	科创板打新限售	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6个月	科创板打新限售	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	新股锁定	10.12	27.73	3,484	35,258.08	96,611.32	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	创业板打新限售	69.66	160.06	600	41,796.00	96,036.00	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月	科创板打新限售	22.68	47.61	1,212	27,488.16	57,703.32	-

688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	科创板打新限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	科创板打新限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打新限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	科创板打新限售	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	创业板打新限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股锁定	53.26	58.74	277	14,753.02	16,270.98	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	创业板打新限售	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	创业板打新限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通	2026-05-08	6个	新股	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-

	利		月	锁定						
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	创业板打新限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	创业板打新限售	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股锁定	11.18	17.59	665	7,434.70	11,697.35	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	创业板打新限售	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	科创板打新限售	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	创业板打新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
--------	------	------------	-----	------	-------	-------	----	----------	----------	---

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	-	832.00	2026-07-13	890.99	4,200	2,730,009.84	3,494,400.00	-

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。本基金通过分散化投资以分散信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

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

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年0 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	25,949,038.77	-	-	-	25,949,038.77
结算备付金	245,928.00	-	-	-	245,928.00
存出保证金	34,020.81	-	-	-	34,020.81
交易性金融资产	9,430,420.93	-	-	603,144,314.55	612,574,735.48
买入返售金融资产	3,500,000.00	-	-	-	3,500,000.00
应收清算款	-	-	-	2,346,073.21	2,346,073.21
应收申购款	-	-	-	273,675.24	273,675.24
资产总计	39,159,408.51	-	-	605,764,063.00	644,923,471.51
负债					

应付赎回款	-	-	-	1,017,579.59	1,017,579.59
应付管理人报酬	-	-	-	233,674.52	233,674.52
应付托管费	-	-	-	51,927.68	51,927.68
应付销售服务费	-	-	-	19,855.43	19,855.43
应交税费	-	-	-	111.80	111.80
其他负债	-	-	-	88,395.25	88,395.25
负债总计	-	-	-	1,411,544.27	1,411,544.27
利率敏感度缺口	39,159,408.51	-	-	604,352,518.73	643,511,927.24
上年度末 2025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	7,586,422.82	-	-	-	7,586,422.82
结算备付金	276,196.82	-	-	-	276,196.82
存出保证金	114,645.97	-	-	-	114,645.97
交易性金融资产	30,302,893.15	-	-	633,752,822.52	664,055,715.67
买入返售金融资产	2,799,237.26	-	-	-	2,799,237.26

应收清算款	-	-	-	516,676.68	516,676.68
应收申购款	-	-	-	157,911.66	157,911.66
资产总计	41,079,396.02	-	-	634,427,410.86	675,506,806.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	921,650.03	921,650.03
应付管理人报酬	-	-	-	264,993.62	264,993.62
应付托管费	-	-	-	58,887.46	58,887.46
应付销售服务费	-	-	-	20,601.67	20,601.67
应交税费	-	-	-	80.81	80.81
其他负债	-	-	-	165,422.68	165,422.68
负债总计	-	-	-	1,431,636.27	1,431,636.27
利率敏感度缺口	41,079,396.02	-	-	632,995,774.59	674,075,170.61

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
假设	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日

	1.市场利率上升25个基点	-203.19	-21,685.29
	2.市场利率下降25个基点	203.59	21,753.90

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

截至报告期末，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	603,144,314.55	93.73	633,752,822.52	94.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	603,144,314.55	93.73	633,752,822.52	94.02
----	----------------	-------	----------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险		
	Beta系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	33,944,183.57	32,757,309.81
	2.业绩比较基准下降5%	-33,944,183.57	-32,757,309.81

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	597,982,429.53	627,314,307.48
第二层次	12,924,820.93	34,757,539.38
第三层次	1,667,485.02	1,983,868.81

合计	612,574,735.48	664,055,715.67
----	----------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	603,144,314.55	93.52
	其中：股票	603,144,314.55	93.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,430,420.93	1.46
	其中：债券	9,430,420.93	1.46
	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	3,500,000.00	0.54
	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	26,194,966.77	4.06

8	其他各项资产	2,653,769.26	0.41
9	合计	644,923,471.51	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	3,424,681.70	0.53
B	采矿业	25,215,835.01	3.92
C	制造业	385,203,227.42	59.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,952,199.62	2.32
E	建筑业	6,875,362.20	1.07
F	批发和零售业	891,801.60	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	14,606,949.58	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,473,777.99	5.05
J	金融业	105,424,976.92	16.38
K	房地产业	1,930,707.00	0.30
L	租赁和商务服务业	2,750,355.57	0.43
M	科学研究和技术服务业	6,541,506.38	1.02
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	821,927.82	0.13
R	文化、体育和娱乐业	347,117.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	601,460,425.81	93.47

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	36,149.82	0.01
C	制造业	1,646,155.46	0.26
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	1,583.46	0.00
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	-	-
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	1,683,888.74	0.26

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	300308	中际旭创	23,660	30,048,200.00	4.67
2	300750	宁德时代	56,198	22,086,375.98	3.43
3	300502	新易盛	29,624	17,981,768.00	2.79
4	600519	贵州茅台	13,248	15,705,371.52	2.44
5	600036	招商银行	362,896	12,882,808.00	2.00
6	603986	兆易创新	14,180	11,556,700.00	1.80
7	601318	中国平安	233,221	11,133,970.54	1.73
8	688256	寒武纪	6,768	10,798,682.40	1.68
9	601899	紫金矿业	350,400	8,809,056.00	1.37
10	002371	北方华创	9,170	8,111,415.20	1.26
11	000333	美的集团	103,776	7,838,201.28	1.22
12	002475	立讯精密	108,428	7,633,331.20	1.19
13	688008	澜起科技	24,315	7,535,218.50	1.17
14	688012	中微公司	16,004	7,497,874.00	1.17
15	688041	海光信息	19,697	7,293,799.10	1.13
16	002384	东山精密	27,300	7,162,155.00	1.11
17	600900	长江电力	260,101	6,884,873.47	1.07
18	688981	中芯国际	42,457	6,743,020.74	1.05
19	000725	京东方 A	772,800	6,707,904.00	1.04
20	603259	药明康德	52,538	6,541,506.38	1.02
21	600030	中信证券	218,585	6,279,947.05	0.98
22	601398	工商银行	881,000	6,228,670.00	0.97
23	601138	工业富联	84,400	6,089,460.00	0.95
24	300059	东方财富	283,556	5,778,871.28	0.90
25	600183	生益科技	31,000	5,375,400.00	0.84
26	600276	恒瑞医药	94,922	4,939,740.88	0.77

27	300274	阳光电源	30,840	4,904,176.80	0.76
28	300408	三环集团	28,500	4,756,650.00	0.74
29	601288	农业银行	782,400	4,749,168.00	0.74
30	601211	国泰海通	253,532	4,614,282.40	0.72
31	002594	比亚迪	57,800	4,606,660.00	0.72
32	300476	胜宏科技	13,000	4,503,590.00	0.70
33	002463	沪电股份	28,600	4,370,080.00	0.68
34	300394	天孚通信	13,888	4,203,619.84	0.65
35	000988	华工科技	21,400	3,950,654.00	0.61
36	301308	江波龙	5,400	3,800,520.00	0.59
37	600176	中国巨石	51,018	3,718,191.84	0.58
38	000651	格力电器	95,622	3,585,825.00	0.56
39	600522	中天科技	58,000	3,519,440.00	0.55
40	688072	拓荆科技	4,200	3,494,400.00	0.54
41	600919	江苏银行	313,370	3,378,128.60	0.52
42	600000	浦发银行	390,616	3,363,203.76	0.52
43	688521	芯原股份	9,000	3,340,260.00	0.52
44	603019	中科曙光	31,145	3,339,678.35	0.52
45	603993	洛阳钼业	185,600	3,257,280.00	0.51
46	600150	中国船舶	95,939	3,241,778.81	0.50
47	600887	伊利股份	134,992	3,234,408.32	0.50
48	600584	长电科技	30,400	3,147,920.00	0.49
49	000338	潍柴动力	114,300	3,114,675.00	0.48
50	000858	五粮液	41,216	3,049,984.00	0.47
51	000001	平安银行	284,424	2,858,461.20	0.44
52	601816	京沪高铁	624,100	2,827,173.00	0.44
53	600309	万华化学	39,900	2,729,559.00	0.42
54	601688	华泰证券	131,200	2,705,344.00	0.42
55	300124	汇川技术	40,312	2,673,894.96	0.42
56	002415	海康威视	77,900	2,664,180.00	0.41
57	002916	深南电路	5,768	2,641,167.20	0.41

58	600111	北方稀土	53,800	2,585,090.00	0.40
59	000100	TCL科技	442,120	2,573,138.40	0.40
60	000063	中兴通讯	68,500	2,479,015.00	0.39
61	600089	特变电工	107,410	2,416,725.00	0.38
62	601857	中国石油	276,500	2,400,020.00	0.37
63	600016	民生银行	722,000	2,324,840.00	0.36
64	601088	中国神华	58,600	2,287,744.00	0.36
65	002028	思源电气	13,200	2,283,600.00	0.35
66	300433	蓝思科技	42,300	2,269,818.00	0.35
67	601988	中国银行	389,800	2,229,656.00	0.35
68	601939	建设银行	230,719	2,221,823.97	0.35
69	600031	三一重工	126,100	2,179,008.00	0.34
70	601601	中国太保	74,836	2,134,322.72	0.33
71	300014	亿纬锂能	32,376	2,105,411.28	0.33
72	002142	宁波银行	70,532	2,094,095.08	0.33
73	002050	三花智控	47,554	2,084,291.82	0.32
74	000792	盐湖股份	67,500	2,037,825.00	0.32
75	002714	牧原股份	58,014	2,029,909.86	0.32
76	600549	厦门钨业	23,600	2,010,720.00	0.31
77	002353	杰瑞股份	13,100	1,997,750.00	0.31
78	600406	国电南瑞	85,335	1,949,904.75	0.30
79	601668	中国建筑	439,200	1,906,128.00	0.30
80	000657	中钨高新	19,400	1,856,968.00	0.29
81	601229	上海银行	212,337	1,843,085.16	0.29
82	601919	中远海控	134,040	1,777,370.40	0.28
83	002602	世纪华通	125,300	1,766,730.00	0.27
84	300760	迈瑞医疗	12,900	1,752,207.00	0.27
85	600660	福耀玻璃	34,105	1,720,256.20	0.27
86	601728	中国电信	330,100	1,713,219.00	0.27
87	603501	豪威集团	18,029	1,710,050.65	0.27
88	601012	隆基绿能	128,861	1,690,656.32	0.26

89	601225	陕西煤业	82,800	1,684,980.00	0.26
90	002230	科大讯飞	40,900	1,670,356.00	0.26
91	600941	中国移动	19,200	1,653,696.00	0.26
92	600690	海尔智家	79,800	1,628,718.00	0.25
93	002352	顺丰控股	50,966	1,593,197.16	0.25
94	601985	中国核电	174,900	1,579,347.00	0.25
95	002460	赣锋锂业	24,060	1,573,524.00	0.24
96	601818	光大银行	539,700	1,559,733.00	0.24
97	002938	鹏鼎控股	14,800	1,559,624.00	0.24
98	600926	杭州银行	107,860	1,558,577.00	0.24
99	002709	天赐材料	30,300	1,558,329.00	0.24
100	603799	华友钴业	32,265	1,557,108.90	0.24
101	000776	广发证券	66,200	1,549,080.00	0.24
102	601169	北京银行	315,900	1,547,910.00	0.24
103	000977	浪潮信息	21,900	1,533,000.00	0.24
104	300033	同花顺	6,360	1,532,760.00	0.24
105	600160	巨化股份	28,700	1,521,387.00	0.24
106	601658	邮储银行	300,300	1,480,479.00	0.23
107	300442	润泽科技	17,400	1,445,418.00	0.22
108	000425	徐工机械	174,300	1,410,087.00	0.22
109	000938	紫光股份	48,662	1,404,385.32	0.22
110	002202	金风科技	58,700	1,402,930.00	0.22
111	688126	沪硅产业	35,103	1,400,258.67	0.22
112	300498	温氏股份	113,212	1,394,771.84	0.22
113	600028	中国石化	311,100	1,387,506.00	0.22
114	600938	中国海油	51,100	1,387,365.00	0.22
115	601600	中国铝业	168,500	1,385,070.00	0.22
116	688082	盛美上海	3,159	1,364,688.00	0.21
117	600460	士兰微	24,800	1,355,568.00	0.21
118	002466	天齐锂业	22,000	1,349,040.00	0.21
119	002600	领益智造	77,700	1,347,318.00	0.21

120	601766	中国中车	258,677	1,345,120.40	0.21
121	600050	中国联通	333,700	1,334,800.00	0.21
122	300661	圣邦股份	9,190	1,318,581.20	0.20
123	601009	南京银行	132,000	1,305,480.00	0.20
124	002837	英维克	16,300	1,296,828.00	0.20
125	601628	中国人寿	36,513	1,290,734.55	0.20
126	002049	紫光国微	14,471	1,284,301.25	0.20
127	002179	中航光电	27,052	1,249,802.40	0.19
128	601100	恒立液压	11,380	1,224,032.80	0.19
129	601872	招商轮船	68,900	1,210,573.00	0.19
130	000568	泸州老窖	15,600	1,209,312.00	0.19
131	002241	歌尔股份	52,800	1,189,584.00	0.18
132	603288	海天味业	35,569	1,179,468.04	0.18
133	601006	大秦铁路	254,400	1,172,784.00	0.18
134	000408	藏格矿业	16,700	1,157,644.00	0.18
135	601916	浙商银行	438,600	1,153,518.00	0.18
136	605117	德业股份	10,811	1,147,911.98	0.18
137	600809	山西汾酒	10,400	1,137,448.00	0.18
138	600905	三峡能源	303,800	1,127,098.00	0.18
139	600489	中金黄金	62,100	1,120,905.00	0.17
140	601888	中国中免	20,767	1,115,395.57	0.17
141	002625	光启技术	36,600	1,109,712.00	0.17
142	600958	东方证券	117,339	1,107,680.16	0.17
143	688396	华润微	11,347	1,106,899.85	0.17
144	000630	铜陵有色	171,000	1,087,560.00	0.17
145	601336	新华保险	18,200	1,085,812.00	0.17
146	600893	航发动力	28,300	1,085,022.00	0.17
147	601998	中信银行	155,400	1,076,922.00	0.17
148	600010	包钢股份	480,700	1,071,961.00	0.17
149	688271	联影医疗	10,552	1,068,178.96	0.17
150	601127	赛力斯	17,400	1,065,750.00	0.17

151	688111	金山办公	4,906	1,045,223.30	0.16
152	601689	拓普集团	18,510	1,044,334.20	0.16
153	002027	分众传媒	215,000	1,040,600.00	0.16
154	600118	中国卫星	12,600	1,033,830.00	0.16
155	600019	宝钢股份	186,000	1,009,980.00	0.16
156	600760	中航沈飞	24,096	990,345.60	0.15
157	000807	云铝股份	44,191	978,388.74	0.15
158	601838	成都银行	54,300	961,110.00	0.15
159	600362	江西铜业	22,100	956,930.00	0.15
160	600104	上汽集团	97,800	954,528.00	0.15
161	600989	宝丰能源	46,800	951,444.00	0.15
162	300450	先导智能	23,300	948,776.00	0.15
163	601995	中金公司	26,200	947,130.00	0.15
164	601727	上海电气	134,100	938,700.00	0.15
165	601377	兴业证券	155,080	936,683.20	0.15
166	002001	新 和 成	32,800	932,176.00	0.14
167	600875	东方电气	32,400	932,148.00	0.14
168	688183	生益电子	7,000	926,800.00	0.14
169	601825	沪农商行	123,000	921,270.00	0.14
170	002422	科伦药业	23,800	916,776.00	0.14
171	601390	中国中铁	217,700	907,809.00	0.14
172	603296	华勤技术	12,096	898,369.92	0.14
173	000538	云南白药	18,940	897,187.80	0.14
174	600048	保利发展	192,300	890,349.00	0.14
175	000166	申万宏源	202,300	890,120.00	0.14
176	600547	山东黄金	38,539	889,865.51	0.14
177	600795	国电电力	189,500	884,965.00	0.14
178	601669	中国电建	183,900	864,330.00	0.13
179	600585	海螺水泥	50,977	864,060.15	0.13
180	601066	中信建投	29,200	848,844.00	0.13
181	603893	瑞芯微	4,500	847,620.00	0.13

182	002648	卫星化学	35,773	840,307.77	0.13
183	300316	晶盛机电	13,900	839,560.00	0.13
184	300015	爱尔眼科	99,507	821,927.82	0.13
185	601698	中国卫通	26,900	813,725.00	0.13
186	600346	恒力石化	45,060	798,012.60	0.12
187	601868	中国能建	298,700	797,529.00	0.12
188	600482	中国动力	24,200	793,760.00	0.12
189	002558	巨人网络	28,400	782,704.00	0.12
190	002311	海大集团	17,500	780,675.00	0.12
191	300418	昆仑万维	19,100	770,876.00	0.12
192	000625	长安汽车	105,934	759,546.78	0.12
193	600066	宇通客车	28,200	756,042.00	0.12
194	600426	华鲁恒升	31,600	755,872.00	0.12
195	002532	天山铝业	69,200	742,516.00	0.12
196	600221	海航控股	548,800	740,880.00	0.12
197	000157	中联重科	106,000	738,820.00	0.11
198	688036	传音控股	12,304	725,320.80	0.11
199	300803	指南针	7,800	715,026.00	0.11
200	600011	华能国际	93,902	712,716.18	0.11
201	605499	东鹏饮料	5,710	704,785.30	0.11
202	600436	片仔癀	6,400	699,392.00	0.11
203	600438	通威股份	57,700	698,747.00	0.11
204	600115	中国东航	181,700	692,277.00	0.11
205	601077	渝农商行	113,300	692,263.00	0.11
206	002236	大华股份	41,900	690,931.00	0.11
207	002736	国信证券	69,000	689,310.00	0.11
208	002493	荣盛石化	63,925	687,193.75	0.11
209	600570	恒生电子	32,310	684,648.90	0.11
210	600886	国投电力	51,300	682,803.00	0.11
211	600188	兖矿能源	38,150	677,925.50	0.11
212	601901	方正证券	92,400	665,280.00	0.10

213	003816	中国广核	167,900	656,489.00	0.10
214	601360	三六零	74,700	649,143.00	0.10
215	601058	赛轮轮胎	56,200	647,986.00	0.10
216	000301	东方盛虹	56,500	646,925.00	0.10
217	688047	龙芯中科	4,169	644,819.23	0.10
218	600026	中远海能	35,600	638,664.00	0.10
219	002074	国轩高科	23,100	635,481.00	0.10
220	601788	光大证券	43,800	632,034.00	0.10
221	601456	国联民生	70,500	623,220.00	0.10
222	001979	招商蛇口	96,600	621,138.00	0.10
223	600009	上海机场	26,600	614,460.00	0.10
224	601881	中国银河	48,800	613,416.00	0.10
225	600196	复星医药	27,100	608,937.00	0.09
226	000768	中航西飞	29,700	608,256.00	0.09
227	000975	山金国际	35,500	603,500.00	0.09
228	601111	中国国航	99,500	601,975.00	0.09
229	600029	南方航空	115,100	596,218.00	0.09
230	600415	小商品城	58,500	594,360.00	0.09
231	600674	川投能源	41,600	589,472.00	0.09
232	600219	南山铝业	147,100	586,929.00	0.09
233	601878	浙商证券	61,600	585,200.00	0.09
234	601186	中国铁建	98,200	584,290.00	0.09
235	600233	圆通速递	36,500	574,875.00	0.09
236	601117	中国化学	78,200	574,770.00	0.09
237	601877	正泰电器	22,900	574,103.00	0.09
238	301236	软通动力	13,300	564,585.00	0.09
239	600372	中航机载	51,600	559,860.00	0.09
240	301269	华大九天	4,600	549,332.00	0.09
241	688506	百利天恒	1,794	527,489.82	0.08
242	000963	华东医药	18,680	525,281.60	0.08
243	600741	华域汽车	33,700	523,024.00	0.08

244	002920	德赛西威	6,300	513,450.00	0.08
245	000895	双汇发展	22,142	495,980.80	0.08
246	002304	洋河股份	12,800	488,320.00	0.08
247	300866	安克创新	4,600	480,700.00	0.07
248	601898	中煤能源	39,100	476,238.00	0.07
249	601021	春秋航空	10,400	474,032.00	0.07
250	600023	浙能电力	85,900	451,834.00	0.07
251	600039	四川路桥	55,660	435,261.20	0.07
252	601800	中国交建	75,900	433,389.00	0.07
253	600515	海南机场	153,000	419,220.00	0.07
254	688223	晶科能源	87,680	416,480.00	0.06
255	600588	用友网络	43,798	402,065.64	0.06
256	601633	长城汽车	26,600	401,394.00	0.06
257	001965	招商公路	43,500	398,460.00	0.06
258	600600	青岛啤酒	7,575	395,642.25	0.06
259	603369	今世缘	16,000	379,360.00	0.06
260	600918	中泰证券	71,100	378,252.00	0.06
261	600061	国投资本	57,415	376,068.25	0.06
262	600027	华电国际	84,500	376,025.00	0.06
263	601618	中国中冶	152,400	371,856.00	0.06
264	601607	上海医药	23,800	366,520.00	0.06
265	300628	亿联网络	10,800	365,256.00	0.06
266	603260	合盛硅业	7,500	361,950.00	0.06
267	302132	中航成飞	6,200	361,584.00	0.06
268	000617	中油资本	54,000	355,860.00	0.06
269	600025	华能水电	39,800	353,822.00	0.05
270	601059	信达证券	21,800	352,942.00	0.05
271	300832	新产业	8,400	352,800.00	0.05
272	300251	光线传媒	31,300	347,117.00	0.05
273	600930	华电新能	71,261	339,914.97	0.05
274	688472	阿特斯	31,200	337,584.00	0.05

275	600085	同仁堂	14,600	337,406.00	0.05
276	000999	华润三九	14,234	320,122.66	0.05
277	600803	新奥股份	19,800	312,840.00	0.05
278	600018	上港集团	64,600	304,912.00	0.05
279	600845	宝信软件	18,300	304,329.00	0.05
280	300122	智飞生物	25,550	298,679.50	0.05
281	300999	金龙鱼	12,700	295,402.00	0.05
282	300896	爱美客	3,180	277,296.00	0.04
283	000596	古井贡酒	3,436	274,192.80	0.04
284	000708	中信特钢	21,500	271,330.00	0.04
285	688009	中国通号	55,129	262,414.04	0.04
286	601018	宁波港	83,100	261,765.00	0.04
287	601238	广汽集团	47,300	240,284.00	0.04
288	688303	大全能源	13,697	238,738.71	0.04
289	300413	芒果超媒	16,000	234,080.00	0.04
290	001280	中国铀业	3,500	233,450.00	0.04
291	301165	锐捷网络	2,800	225,260.00	0.04
292	603392	万泰生物	8,092	218,241.24	0.03
293	601136	首创证券	12,300	171,585.00	0.03
294	001391	国货航	31,286	127,334.02	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	301666	大普微	984	455,916.72	0.07
2	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.04
3	688820	盛合晶微	943	133,425.07	0.02
4	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.02
5	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.02

6	001399	惠科股份	3,484	96,611.32	0.02
7	301682	宏明电子	600	96,036.00	0.01
8	688781	视涯科技	1,212	57,703.32	0.01
9	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
10	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
11	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
12	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
13	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
14	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
15	001237	惠康科技	277	16,270.98	0.00
16	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
17	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
18	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
19	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
20	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
21	601112	振石股份	665	11,697.35	0.00
22	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
23	301667	纳百川	151	10,920.32	0.00
24	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
25	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
26	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
27	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
28	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
29	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
30	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
31	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
32	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	000988	华工科技	3,266,696.00	0.48
2	301308	江波龙	2,845,688.00	0.42
3	688072	拓荆科技	2,730,009.84	0.41
4	688521	芯原股份	2,007,926.20	0.30
5	002353	杰瑞股份	1,935,543.00	0.29
6	002602	世纪华通	1,846,211.00	0.27
7	000657	中钨高新	1,568,776.00	0.23
8	600549	厦门钨业	1,544,244.00	0.23
9	002202	金风科技	1,281,395.00	0.19
10	002837	英维克	1,097,152.00	0.16
11	600118	中国卫星	994,541.00	0.15
12	601727	上海电气	989,225.00	0.15
13	300450	先导智能	985,452.00	0.15
14	002532	天山铝业	944,914.00	0.14
15	688183	生益电子	902,064.76	0.13
16	600221	海航控股	849,519.00	0.13
17	002558	巨人网络	678,821.00	0.10
18	600183	生益科技	605,171.00	0.09
19	688012	中微公司	428,110.00	0.06
20	601456	国联民生	324,315.00	0.05

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	300750	宁德时代	3,764,973.00	0.56

2	300308	中际旭创	3,331,137.00	0.49
3	600519	贵州茅台	3,251,551.00	0.48
4	600036	招商银行	2,634,734.00	0.39
5	601318	中国平安	2,538,202.00	0.38
6	601899	紫金矿业	2,143,375.00	0.32
7	300502	新易盛	1,921,737.80	0.29
8	000333	美的集团	1,546,745.00	0.23
9	600900	长江电力	1,247,981.00	0.19
10	601398	工商银行	1,180,132.00	0.18
11	002475	立讯精密	1,180,121.00	0.18
12	688818	电科蓝天	1,117,570.83	0.17
13	688808	联讯仪器	1,098,160.65	0.16
14	601088	中国神华	1,062,889.00	0.16
15	688256	寒武纪	1,034,727.80	0.15
16	300059	东方财富	989,633.00	0.15
17	688041	海光信息	986,913.36	0.15
18	600030	中信证券	978,080.00	0.15
19	002594	比亚迪	973,091.00	0.14
20	601288	农业银行	966,168.00	0.14

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	32,707,224.39
卖出股票收入（成交）总额	115,026,823.46

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,430,420.93	1.47
	其中：政策性金融债	9,430,420.93	1.47
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	9,430,420.93	1.47

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018012	国开2003	92,000	9,430,420.93	1.47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

招商银行（代码：600036.SH）为本基金前十大持仓证券。2025年6月5日，据深圳市交通运输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在2025年04月09日15时07分在广东省深圳市南山区白石四道南侧（深圳湾睿印对面）实施了未按照批准的期限占用城市道路（一年内第一次被查处）的违法行为，深圳市交通运输局处以罚款4000元。2025年9月12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数据安全管理工作不到位，国家金融监督管理总局给予警告并处以罚款60万元。

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

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。
除上述证券外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,020.81
2	应收清算款	2,346,073.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	273,675.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,653,769.26

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	301666	大普微	455,916.72	0.07	创业板打新限售
2	688808	联讯仪器	258,245.79	0.04	科创板打新限售
3	688820	盛合晶微	133,425.07	0.02	科创板打新限售
4	688818	电科蓝天	120,430.38	0.02	科创板打新限售
5	688797	臻宝科技	97,014.69	0.02	科创板打新限售

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 沪深3 00A	18, 221	21,348.70	289,661,158.71	74.4 6%	99,333,447.01	25.54%
人保 沪深3	590	67,329.41	37,230,139.22	93.7 2%	2,494,214.12	6.28%

00C						
合计	18,722	22,899.21	326,891,297.93	76.25%	101,827,661.13	23.75%

注：1、机构、个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	人保沪深300A	234,117.09	0.06%
	人保沪深300C	7,264.87	0.02%
	合计	241,381.96	0.06%

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	人保沪深300A	10~50
	人保沪深300C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	人保沪深300A	0
	人保沪深300C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	人保沪深300A	人保沪深300C
基金合同生效日(2019年02月28	205,770,647.89	-

日)基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	446,652,435.02	42,805,964.06
本报告期基金总申购份额	23,695,783.84	4,477,023.69
减：本报告期基金总赎回份额	81,353,613.14	7,558,634.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	388,994,605.72	39,724,353.34

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	38,113,028.07	26.14%	5,179.64	26.15%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	20,289,098.08	13.92%	2,757.40	13.92%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	43,854,051.18	30.08%	5,959.95	30.08%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	43,519,449.86	29.85%	5,914.15	29.85%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下：

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无新增或退租交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长江证券	1,000,500.00	9.67%	94,800,000.00	40.79%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	9,347,030.00	90.33%	137,600,000.00	59.21%	-	-	-	-

长城证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	公司旗下基金2025年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-21
2	人保沪深300指数型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-21
3	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-02-28
4	关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-14
5	人保沪深300指数型证券投资基金招募说明书更新（2026年第1号）	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-14
6	人保沪深300指数型证券投资基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-14
7	中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-28
8	公司旗下基金2025年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
9	人保沪深300指数型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
10	中国人保资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-31
11	中国人保资产管理有限公司关于调整旗下部分基金风险	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-17

	评级相关事项的公告		
12	公司旗下基金2026年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-21
13	人保沪深300指数型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-21
14	中国人保资产管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回份额和最低持有份额的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-06
15	2025年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-08
16	关于暂停网上交易系统服务的通知	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-12

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260630	234,582,707.55	-	-	234,582,707.55	54.72%
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。 当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予人保沪深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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

基金托管人地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

二〇二六年八月二十九日