

人保中证500指数型证券投资基金

2022年第2季度报告

2022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

报告送出日期:2022年07月20日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	6
4.3 公平交易专项说明	6
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	6
4.5 报告期内基金的业绩表现	6
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	6
§5 投资组合报告	7
5.1 报告期末基金资产组合情况	7
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	7
5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	9
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	9
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	10
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	10
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	10
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	10
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	10
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	10
5.11 投资组合报告附注	10
§6 开放式基金份额变动	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	13
§8 影响投资者决策的其他重要信息	13
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	13
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	13
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	13

§ 1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	32,821,026.04份
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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年04月01日 - 2022年06月30日）
1. 本期已实现收益	341,819.20
2. 本期利润	2,045,140.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0775
4. 期末基金资产净值	51,549,310.04
5. 期末基金份额净值	1.5706

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.17%	1.61%	1.99%	1.66%	1.18%	-0.05%
过去六个月	-10.55%	1.50%	-11.65%	1.55%	1.10%	-0.05%
过去一年	-3.52%	1.23%	-4.83%	1.26%	1.31%	-0.03%
过去三年	41.13%	1.26%	29.13%	1.28%	12.00%	-0.02%
自基金合同生效起至今	57.06%	1.31%	44.24%	1.34%	12.82%	-0.03%

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

人保中证500指数型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年12月07日-2022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，建仓期满，本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石晓冉	基金经理	2020-08-03	-	5年	北京师范大学统计学硕士。曾任中信建投基金管理有限公司量化研究员。2018年8月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，历任量化研究员、基金经理助理，2020年8月3日起任人保沪深300指数型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金和人保量化基本面混合型证券投资基金基金经理，2020年12月23日至2022年4月19日任人保量化锐进混合型发起式证券投资基金基金经理，2022年4月14日起任人保优势产业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》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

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

本基金作为一只跟踪中证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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保中证500基金份额净值为1.5706元，本报告期内，基金份额净值增长率为3.17%，同期业绩比较基准收益率为1.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金自2022年4月1日至2022年6月28日连续57个工作日净值低于5000万，公司正在完善相关方案。本报告期内本基金未出现连续20个工作日基金持有人数不满二百人的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	47,625,702.41	88.14
	其中：股票	47,625,702.41	88.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,008,189.62	1.87
	其中：债券	1,008,189.62	1.87
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,553,303.39	6.58
8	其他资产	1,844,658.92	3.41
9	合计	54,031,854.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	423,984.40	0.82
B	采矿业	2,103,625.46	4.08
C	制造业	28,504,452.85	55.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,489,558.84	2.89
E	建筑业	564,423.00	1.09
F	批发和零售业	1,829,752.74	3.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,202,988.26	2.33
H	住宿和餐饮业	104,656.00	0.20

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,360,156.00	6.52
J	金融业	4,226,078.39	8.20
K	房地产业	1,041,609.15	2.02
L	租赁和商务服务业	536,378.40	1.04
M	科学研究和技术服务业	590,849.00	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	317,715.56	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	108,850.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	606,240.16	1.18
S	综合	364,191.00	0.71
	合计	47,375,509.21	91.90

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	228,119.90	0.44
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,676.50	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,396.80	0.02
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	250,193.20	0.49

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600522	中天科技	20,800	480,480.00	0.93
2	601615	明阳智能	11,500	388,700.00	0.75
3	600256	广汇能源	35,600	375,224.00	0.73
4	688122	西部超导	4,000	368,800.00	0.72
5	601108	财通证券	46,300	364,381.00	0.71
6	300012	华测检测	12,900	299,409.00	0.58
7	002497	雅化集团	8,900	290,585.00	0.56
8	300769	德方纳米	700	286,076.00	0.55
9	002240	盛新锂能	4,700	283,692.00	0.55
10	600096	云天化	8,700	273,876.00	0.53

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002013	中航机电	15,749	194,500.15	0.38
2	001318	阳光乳业	648	14,327.28	0.03
3	603206	嘉环科技	605	11,676.50	0.02
4	688065	凯赛生物	100	11,180.00	0.02
5	001228	永泰运	192	10,396.80	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

1	国家债券	1,008,189.62	1.96
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	1,008,189.62	1.96

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22国债01	9,970	1,008,189.62	1.96

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 中天科技（代码：600522.SH）为本基金前十大持仓证券。2022年6月20日，公司收到上交所《关于对江苏中天科技股份有限公司及有关责任人予以监管警示的决定》；

公司前期部分会计核算和会计处理存在差错，导致多期定期报告相关财务信息披露不准确，其行为违反了《公开发行证券的公司信息披露编报规则第15号——财务报告的一般规定》《上海证券交易所股票上市规则》（2020年修订）第1.4条、第2.1条、第2.5条等有关规定，上交所决定对公司及时任财务总监高洪时予以监管警示。2022年1月11日，公司收到上交所《关于对江苏中天科技股份有限公司及有关责任人予以监管警示的决定》；公司时任董事会秘书杨栋云、时任副总经理肖方印等公司工作人员于2021年10月31日以电话会议形式召开机构调研会与机构投资者交流三季报业绩，透露公司重要业务板块订单量和预测性数据等信息，表明公司相关信息披露不公平，信息披露管理制度存在缺陷。上交所决定对公司予以监管警示。2021年7月21日，公司收到上交所《关于江苏中天科技股份有限公司重大风险事项的监管工作函》，处理事由为：督促公司妥善处理风险事项、合规履行信息披露义务。

财通证券（代码：601108.SH）为本基金前十大持仓证券。2021年11月19日，公司收到中国证监会《关于对财通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》，公司存在以下违规行为：一是财通国际投资有限公司在境外经营放债业务，与两企业签订的贷款协议于2019年7月到期后，未按规定到期终结，而是通过签订附加协议对贷款予以展期；二是公司对全资子公司的系统对接未有效覆盖财通证券（香港）有限公司业务，风险数据集市未实现对该公司自营、投行及资管业务的对接；三是财通证券（香港）有限公司自2019年以来，多次出现为客户下单时错误使用另外一位客户账户的情形；四是风险管理系统尚未集成声誉风险管理模块，企业风险管理平台未实现衍生品业务相关希腊字母的计算功能，相关指标依赖手工计算且未实现。公司上述违规行为违反了《证券公司风险控制指标管理办法》《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》《证券公司监督管理条例》，中国证监会责令公司改正。

盛新锂能（代码：002040.SZ）为本基金前十大持仓证券。2022年6月8日，公司披露收到深交所上市公司管理一部下发的《关于对盛新锂能集团股份有限公司的监管函》；提及需引起公司充分重视、杜绝再次发生的问题包括：第一，公司自2021年9月收购SESA后至2022年2月底，合计为UT联合体提供了334.37万美元（按照2021年年报折算汇率折算人民币为2,131.84万元）的财务资助，但直至2022年3月28日，公司才对上述财务资助履行董事会审议程序及信息披露义务。第二，公司于2021年4月30日披露的《关于出售参股公司广东威利邦木业有限公司股权暨关联交易的公告》显示，出售参股公司关联交易金额3.55亿元，占2020年经审计净资产的11.03%，交易标的财务数据截止日为2020年9月30日且未经审计。2021年9月3日，公司披露收到深交所下发的《关于对深圳盛新锂能集团股份有限公司及相关当事人给予纪律处分的决定》，指出公司财务会计报告存在重大会计差错、违规对外提供担保，违反了深交所《股票上市规则（2018年11月修订）》相关规定，并根据《股票上市规则（2018年11月修订）》第17.2条、第17.3条、第17.4条的规定，以及《上市公司纪律处分实施标准（试行）》第十三条、第二十二的规定，作出对深圳盛新锂能集团股份有限公司给予通报批评的处分，同时记入上市公司诚信档案，并向社会公开。

本基金投资中天科技、财通证券、盛新锂能的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除中天科技、财通证券、盛新锂能之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,041.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,838,617.67
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,844,658.92

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	21,701,101.86
报告期期间基金总申购份额	18,318,690.89
减：报告期期间基金总赎回份额	7,198,766.71

报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	32,821,026.04

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

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区西长安街88号中国人保大厦

基金托管人地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

2022年07月20日