

人保沪深 300 指数型证券投资基金

2022 年中期报告

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

送出日期:2022 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2022年8月26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1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	59
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	59
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	59
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	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	人保沪深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	369,049,620.93份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深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	吕传红
	联系电话	010-69009696
	电子邮箱	lvch@piccamc.com
客户服务电话	400-820-7999	95559

传真	021-50765598	021-62701216
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	北京市西城区西长安街88号 中国人保大厦8层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	100031	200336
法定代表人	曾北川	任德奇

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日- 2022年06月30日)
	本期已实现收益
本期利润	-15,178,680.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0528
本期加权平均净值利润率	-3.82%
本期基金份额净值增长率	-7.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)

期末可供分配利润	168,975,775.14
期末可供分配基金份额利润	0.4579
期末基金资产净值	538,025,396.07
期末基金份额净值	1.4579
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)
基金份额累计净值增长率	45.79%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.98%	1.00%	9.12%	1.02%	0.86%	-0.02%
过去三个月	7.08%	1.34%	5.93%	1.36%	1.15%	-0.02%
过去六个月	-7.52%	1.35%	-8.72%	1.38%	1.20%	-0.03%
过去一年	-9.62%	1.16%	-13.40%	1.18%	3.78%	-0.02%
过去三年	43.76%	1.19%	16.70%	1.20%	27.06%	-0.01%
自基金合同生效起至今	45.79%	1.19%	21.19%	1.24%	24.60%	-0.05%

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300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
(2019年02月28日-2022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，建仓期满，本基金的各项投资比例应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（简称人保资产）成立于2003年7月16日，是经国务院同意、原中国保监会批准设立的境内第一家保险资产管理公司，由中国人民保险集团股份有限公司（股票代码：601319.SH, 1339.HK）发起。目前管理资产逾万亿元人民币，具备银保监会核准的股票投资能力、无担保债券投资能力、股权投资能力、基础设施投资计划产品创新能力、不动产投资计划产品创新能力、衍生品运用能力和信托产品投资能力，具有国家外管局批准的经营外汇业务资格，获选基本养老保险基金证券投资基金管理机构，获准发行投资理财产品和受托管理合格投资者资金，获批开展公募基金业务，是中国资本市场秉持价值投资理念、为客户创造绝对收益的重要机构投资者之一。

成立十八年来，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。

十八年来，中国金融市场日趋成熟，财富管理行业日渐交融。人保资产科学筹划发展战略，积极把握第三方业务的发展机遇和另类资产的投资机会，在国内保险资产管理机构中较早开展了第三方保险机构的专户管理业务，并积极创新和开展股权投资、基础设施债权投资业务、资产管理产品等业务，积极筹备公募基金业务，形成了专户管理、资产管理产品、债权投资计划、股权投资计划、不动产投资计划和外汇投资等业务多元化发展的格局，与国内各主要金融机构和大中型龙头企业建立了良好的合作关系。

自成立以来，人保资产始终坚持专业化发展、市场化经营、规范化运作，是第一家建立“委托-受托-托管”资金三方存管机制的保险资产管理机构，并探索建立了覆盖投资全流程的风险防控体系；十八年来，人保资产还培养了具备国际投资视野、历经市场多周期磨练的投研管理和业务执行团队，忠实履行了对各委托人的价值创造承诺。

面向潜力无限、变革加快、竞争激烈的财富管理市场，人保资产将始终坚持人民至上，牢记“人民保险，服务人民”的企业使命，恪守“诚信、专业、创新、卓越”的企业核心价值观，实现“建设全球卓越保险集团”的企业愿景。

人保资产于2017年1月11日获得中国证监会《关于核准中国人保资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]107号），于2017年3月29日获得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。截至2022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、人保纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保量化基本面混合型证券投资基金、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保优势产业混合型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保福睿18个月定期开放债券型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金、人保中高等级信用债债券型证券投资基金、人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保量化锐进混合型发起式证券投资基金和人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

石晓冉	基金经理	2020-08-03	-	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300基金份额净值为1.4579元，本报告期内，基金份额净值增长率为-7.52%，同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

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2022年下半年，关注的重点将围绕疫情后经济恢复程度以及流动性宽松程度这两个核心变量。伴随疫情好转，国内的生产活动和消费活动将复苏，但同时市场流动性出现边际收缩，影响市场整体的风险偏好。行业层面上，上游周期品目前处于价格高位震荡，新能源金属方面锂价仍然坚挺，钴、镍等原材料价格小幅回调。中游制造相关行业随着实体经济的回暖景气度也将回升，汽车伴随购置税政策实施及疫情好转，其零售市场呈现继续回暖趋势。新能源产业链中风电、光伏、储能和锂电池产业链仍处在景气和估值戴维斯双击的过程之中，但需要密切关注市场风险偏好的变化对其估值的影响。下游消费方面，猪肉相关产业中长期景气度较高，白酒行业较高的盈利确定性仍是其配置价值的主要体现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所管理人在管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值委员会，成员主要由公募基金事业部相关领导、投资部门、研究部门、合规风控部门、运营管理部门人员组成，以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理列席会议，但不参与具体决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种、流通受限股票等的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，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，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：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	31,394,568.34	18,229,489.38

结算备付金		334,628.65	7,989.43
存出保证金		71,098.65	6,735.93
交易性金融资产	6.4.7.2	514,455,585.00	245,388,135.06
其中：股票投资		501,307,341.11	245,388,135.06
基金投资		-	-
债券投资		13,148,243.89	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	72,153.09
应收股利		-	-
应收申购款		11,045,622.10	1,994,142.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	4,087.27
资产总计		557,301,502.74	265,702,732.54
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021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		5,364,191.16	-
应付赎回款		13,240,739.24	707,451.17
应付管理人报酬		178,635.48	87,628.64
应付托管费		39,696.79	19,473.01
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	452,844.00	267,859.20
负债合计		19,276,106.67	1,082,412.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	369,049,620.93	167,855,634.21
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	168,975,775.14	96,764,686.31
净资产合计		538,025,396.07	264,620,320.52
负债和净资产总计		557,301,502.74	265,702,732.54

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额369,049,620.93份，份额净值1.4579元。

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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-13,924,226.08	11,332,190.69
1. 利息收入		84,566.65	130,770.70
其中：存款利息收入	6.4.7.9	84,425.28	17,660.58
债券利息收入		-	113,110.12

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		141.37	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,428,069.57	38,699,574.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-6,098,252.87	37,609,928.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	105,556.16	-30,163.10
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	4,564,627.14	1,119,808.78
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-12,890,334.25	-27,671,825.34
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	309,611.09	173,670.88
减：二、营业总支出		1,254,454.43	1,122,288.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	878,805.62	489,222.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	195,290.14	108,716.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.	-	-

	3		
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	180,358.67	524,350.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,178,680.51	10,209,901.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,178,680.51	10,209,901.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-15,178,680.51	10,209,901.80

6.3 净资产（基金净值）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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	167,855,634.21	-	96,764,686.31	264,620,320.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	167,855,634.21	-	96,764,686.31	264,620,320.

(基金净值)				52
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	201,193,986.72	-	72,211,088.83	273,405,075.55
(一)、综合收益总额	-	-	-15,178,680.51	-15,178,680.51
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	201,193,986.72	-	87,389,769.34	288,583,756.06
其中: 1. 基金申购款	379,366,060.14	-	153,040,882.98	532,406,943.12
2. 基金赎回款	-178,172,073.42	-	-65,651,113.64	-243,823,187.06
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动(净 值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	369,049,620.93	-	168,975,775.14	538,025,396.07
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综 合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	216,763,337.82	-	125,530,995.06	342,294,332.88
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	216,763,337.82	-	125,530,995.06	342,294,332.88

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-101,098,074.57	-	-54,631,934.17	-155,730,008.74
(一)、综合收益总额	-	-	10,209,901.80	10,209,901.80
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-101,098,074.57	-	-64,841,835.97	-165,939,910.54
其中: 1. 基金申购款	30,585,394.81	-	18,764,739.36	49,350,134.17
2. 基金赎回款	-131,683,469.38	-	-83,606,575.33	-215,290,044.71
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动(净 值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	115,665,263.25	-	70,899,060.89	186,564,324.14

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:

曾北川

韩松

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,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(19)

第00031号验资报告。基金合同于2019年2月28日正式生效。本基金的基金管理人为中国人保资产管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股、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

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金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不一致。

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

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021年的比较数据将不作重述。

1、金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产,暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付,且本基金管理该金融资产的商业模式是以收取合同现金流量为目标,则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

2、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的,在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债,或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额;支

付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

3、金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

4、收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90

号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	31,394,568.34
等于：本金	31,388,813.64
加：应计利息	5,754.70
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	31,394,568.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	493,039,835.55	-	501,307,341.11	8,267,505.56	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,029,502.20	126,623.89	13,148,243.89	-7,882.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,029,502.20	126,623.89	13,148,243.89	-7,882.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	506,069,337.75	126,623.89	514,455,585.00	8,259,623.36	

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

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	47,435.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	176,065.18
其中：交易所市场	176,065.18
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
其他应付	150,000.00
合计	452,844.00

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	167,855,634.21	167,855,634.21
本期申购	379,366,060.14	379,366,060.14
本期赎回（以“-”号填列）	-178,172,073.42	-178,172,073.42
本期末	369,049,620.93	369,049,620.93

注：本期申购含红利再投、转换入、分级调整的份(金)额，本期赎回含转换出、分级调整的份(金)额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	103,622,645.61	-6,857,959.30	96,764,686.31
本期利润	-2,288,346.26	-12,890,334.25	-15,178,680.51
本期基金份额交易产生的变动数	123,977,004.81	-36,587,235.47	87,389,769.34
其中：基金申购款	233,084,706.64	-80,043,823.66	153,040,882.98
基金赎回款	-109,107,701.83	43,456,588.19	-65,651,113.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	225,311,304.16	-56,335,529.02	168,975,775.14

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	79,878.19
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	4,150.12
其他	396.97
合计	84,425.28

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	90,030,790.24
减：卖出股票成本总额	95,655,841.06
减：交易费用	473,202.05
买卖股票差价收入	-6,098,252.87

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 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	105,569.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-13.05
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	105,556.16

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 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	13.05
买卖债券差价收入	-13.05

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
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	4,564,627.14
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	4,564,627.14

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-12,890,334.25
——股票投资	-12,882,452.05
——债券投资	-7,882.20
——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	-12,890,334.25

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	309,611.09
合计	309,611.09

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
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,015.51
其他费用_指数使用费	100,000.00
合计	180,358.67

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露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 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	878,805.62	489,222.23
其中：支付销售机构的客户维护费	209,485.45	65,206.97

注：支付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 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	195,290.14	108,716.06

注：支付的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
基金合同生效日（2019年02月28日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	10,137,884.42	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00

报告期末持有的基金份额	10,137,884.42	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.75%	0.00%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021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
中国人民人寿保险股份有限公司	50,667,815.16	13.73%	50,667,815.16	30.19%

本报告期末除上述情形外无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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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	31,394,568.34	79,878.19	3,505,783.21	16,575.09

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（2022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
600938	中国海油	2022-04-14	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	42,002	453,621.60	666,151.72	-
688297	中无人机	2022-06-17	6个月	新股流通受限	32.35	45.88	8,715	281,930.25	399,844.20	-
688238	和元生物	2022-03-15	6个月	新股流通受限	13.23	25.32	12,836	169,820.28	325,007.52	-
301139	元道通信	2022-06-30	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
688237	超卓航科	2022-06-24	6个月	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301238	瑞泰新材	2022-06-10	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	1,372	26,314.96	44,000.04	-
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	新股流通受限	52.03	56.42	407	21,176.21	22,962.94	-

301139	元道通信	2022-06-30	6个月	新股流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301162	国能日新	2022-04-19	6个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301120	新特电气	2022-04-11	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	新股流通受限	109.04	82.76	189	20,608.56	15,641.64	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	新股流通受限	23.21	16.14	966	22,417.64	15,591.24	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	444	15,841.92	13,248.96	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月	新股流通受限	48.53	31.38	416	20,187.76	13,054.08	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-

301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	新股流通受限	32.69	32.02	377	12,325.00	12,071.54	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月	新股流通受限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	344	13,718.72	10,694.96	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月	新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6个月	新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	新股流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	新股流通受限	96.46	87.82	101	9,742.88	8,869.82	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

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 2022年06月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	31,394,568.34	-	-	-	31,394,568.34
结算备付金	334,628.65	-	-	-	334,628.65
存出保证金	71,098.65	-	-	-	71,098.65
交易性金融资产	13,148,243.89	-	-	501,307,341.11	514,455,585.00
应收申购款	-	-	-	11,045,622.10	11,045,622.10
资产总计	44,948,539.53	-	-	512,352,963.21	557,301,502.74
负债					
应付清算款	-	-	-	5,364,191.16	5,364,191.16
应付赎回款	-	-	-	13,240,739.24	13,240,739.24
应付管理人	-	-	-	178,635.48	178,635.48

报酬					
应付托管费	-	-	-	39,696.79	39,696.79
其他负债	-	-	-	452,844.00	452,844.00
负债总计	-	-	-	19,276,106.67	19,276,106.67
利率敏感度缺口	44,948,539.53	-	-	493,076,856.54	538,025,396.07
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,229,489.38	-	-	-	18,229,489.38
结算备付金	7,989.43	-	-	-	7,989.43
存出保证金	6,735.93	-	-	-	6,735.93
交易性金融资产	-	-	-	245,388,135.06	245,388,135.06
应收证券清算款	-	-	-	72,153.09	72,153.09
应收申购款	-	-	-	1,994,142.38	1,994,142.38
其他资产	-	-	-	4,087.27	4,087.27
资产总计	18,244,214.74	-	-	247,458,517.80	265,702,732.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	707,451.17	707,451.17
应付管理人报酬	-	-	-	87,628.64	87,628.64
应付托管费	-	-	-	19,473.01	19,473.01
其他负债	-	-	-	267,859.20	267,859.20
负债总计	-	-	-	1,082,412.02	1,082,412.02
利率敏感度缺口	18,244,214.74	-	-	246,376,105.78	264,620,320.52

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 市场利率上升25个基点	-17,400.34	-
	2. 市场利率下降25个基点	17,466.30	-

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 2022年06月30日		上年度末 2021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	501,307,341.11	93.18	245,388,135.06	92.73
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	501,307,341.11	93.18	245,388,135.06	92.73

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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准增加5%	25,874,834.78	12,943,553.62
	2. 业绩比较基准减少5%	-25,874,834.78	-12,943,553.62

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报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	499,220,205.48	244,903,029.81
第二层次	13,550,328.44	5,504.49
第三层次	1,685,051.08	479,600.76
合计	514,455,585.00	245,388,135.06

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2022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、买入返售金融资产和其他金融负债等，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	501,307,341.11	89.95
	其中：股票	501,307,341.11	89.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,148,243.89	2.36
	其中：债券	13,148,243.89	2.36
	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	31,729,196.99	5.69

8	其他各项资产	11,116,720.75	1.99
9	合计	557,301,502.74	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	5,332,742.26	0.99
B	采矿业	17,902,196.84	3.33
C	制造业	292,581,893.60	54.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,101,613.12	2.25
E	建筑业	9,962,156.00	1.85
F	批发和零售业	1,091,272.80	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	13,259,334.58	2.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,009,057.46	2.60
J	金融业	100,434,502.48	18.67
K	房地产业	7,832,440.00	1.46
L	租赁和商务服务业	6,001,886.31	1.12
M	科学研究和技术服务业	6,280,863.86	1.17
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	217,125.00	0.04
Q	卫生和社会工作	5,125,228.00	0.95
R	文化、体育和娱乐业	510,408.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	492,642,720.31	91.56

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	2,996,858.72	0.56
C	制造业	4,015,010.63	0.75
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	533,289.16	0.10
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	576,906.28	0.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	31,434.41	0.01
M	科学研究和技术服务业	325,007.52	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	174,042.54	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,071.54	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,664,620.80	1.61

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产
----	------	------	-------	---------	-------

					净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	16,036	32,793,620.00	6.10
2	300750	宁德时代	31,432	16,784,688.00	3.12
3	600036	招商银行	296,496	12,512,131.20	2.33
4	601318	中国平安	257,121	12,004,979.49	2.23
5	601012	隆基绿能	152,729	10,176,333.27	1.89
6	000858	五粮液	40,611	8,200,579.23	1.52
7	600030	中信证券	300,690	6,512,945.40	1.21
8	002594	比亚迪	18,200	6,069,518.00	1.13
9	000568	泸州老窖	23,700	5,842,998.00	1.09
10	000001	平安银行	387,924	5,811,101.52	1.08
11	600438	通威股份	92,900	5,560,994.00	1.03
12	300059	东方财富	213,380	5,419,852.00	1.01
13	600809	山西汾酒	16,400	5,326,720.00	0.99
14	000333	美的集团	88,130	5,322,170.70	0.99
15	600900	长江电力	229,601	5,308,375.12	0.99
16	002129	TCL中环	83,100	4,893,759.00	0.91
17	601888	中国中免	19,867	4,627,620.31	0.86
18	002466	天齐锂业	36,000	4,492,800.00	0.84
19	002460	赣锋锂业	29,800	4,431,260.00	0.82
20	601899	紫金矿业	472,800	4,411,224.00	0.82
21	603259	药明康德	41,114	4,275,444.86	0.79
22	000651	格力电器	122,122	4,117,953.84	0.77
23	002304	洋河股份	22,100	4,047,615.00	0.75
24	000625	长安汽车	233,434	4,043,076.88	0.75
25	600887	伊利股份	103,292	4,023,223.40	0.75
26	601398	工商银行	824,800	3,934,296.00	0.73
27	601668	中国建筑	731,900	3,893,708.00	0.72
28	002709	天赐材料	59,900	3,717,394.00	0.69
29	600089	特变电工	129,900	3,557,961.00	0.66
30	002415	海康威视	94,300	3,413,660.00	0.63

31	600919	江苏银行	476,070	3,389,618.40	0.63
32	002475	立讯精密	99,728	3,369,809.12	0.63
33	601225	陕西煤业	158,300	3,352,794.00	0.62
34	600276	恒瑞医药	90,382	3,352,268.38	0.62
35	601919	中远海控	233,040	3,239,256.00	0.60
36	601658	邮储银行	599,700	3,232,383.00	0.60
37	600426	华鲁恒升	109,500	3,197,400.00	0.59
38	002714	牧原股份	57,614	3,184,325.78	0.59
39	601088	中国神华	95,100	3,166,830.00	0.59
40	600309	万华化学	31,800	3,084,282.00	0.57
41	300760	迈瑞医疗	9,800	3,069,360.00	0.57
42	603659	璞泰来	35,800	3,021,520.00	0.56
43	002241	歌尔股份	88,000	2,956,800.00	0.55
44	002142	宁波银行	79,932	2,862,364.92	0.53
45	600000	浦发银行	353,586	2,832,223.86	0.53
46	000002	万科A	137,500	2,818,750.00	0.52
47	600016	民生银行	741,900	2,759,868.00	0.51
48	002812	恩捷股份	10,900	2,729,905.00	0.51
49	601288	农业银行	886,700	2,677,834.00	0.50
50	603288	海天味业	28,224	2,550,320.64	0.47
51	600905	三峡能源	403,300	2,536,757.00	0.47
52	600048	保利发展	145,000	2,531,700.00	0.47
53	603799	华友钴业	25,765	2,463,649.30	0.46
54	300124	汇川技术	37,312	2,457,741.44	0.46
55	300015	爱尔眼科	54,700	2,448,919.00	0.46
56	600028	中国石化	595,400	2,429,232.00	0.45
57	000725	京东方A	615,400	2,424,676.00	0.45
58	600926	杭州银行	160,960	2,411,180.80	0.45
59	002821	凯莱英	8,200	2,369,800.00	0.44
60	601009	南京银行	225,100	2,345,542.00	0.44
61	600176	中国巨石	132,003	2,298,172.23	0.43

62	600031	三一重工	120,000	2,287,200.00	0.43
63	300014	亿纬锂能	22,976	2,240,160.00	0.42
64	600436	片仔癀	6,200	2,211,726.00	0.41
65	002352	顺丰控股	39,566	2,208,178.46	0.41
66	601838	成都银行	131,300	2,176,954.00	0.40
67	600584	长电科技	80,200	2,165,400.00	0.40
68	300498	温氏股份	100,912	2,148,416.48	0.40
69	603392	万泰生物	13,780	2,140,034.00	0.40
70	600690	海尔智家	76,600	2,103,436.00	0.39
71	300274	阳光电源	21,100	2,073,075.00	0.39
72	601816	京沪高铁	396,400	1,989,928.00	0.37
73	601601	中国太保	83,536	1,965,602.08	0.37
74	601988	中国银行	596,200	1,943,612.00	0.36
75	600837	海通证券	194,800	1,910,988.00	0.36
76	601818	光大银行	627,300	1,888,173.00	0.35
77	603882	金域医学	22,700	1,873,885.00	0.35
78	002555	三七互娱	87,800	1,863,994.00	0.35
79	002271	东方雨虹	35,850	1,845,199.50	0.34
80	000977	浪潮信息	69,600	1,843,008.00	0.34
81	603501	韦尔股份	10,603	1,834,637.09	0.34
82	600406	国电南瑞	67,196	1,814,292.00	0.34
83	300122	智飞生物	16,200	1,798,362.00	0.33
84	688981	中芯国际	39,148	1,768,315.16	0.33
85	600585	海螺水泥	48,477	1,710,268.56	0.32
86	600104	上汽集团	94,500	1,683,045.00	0.31
87	002049	紫光国微	8,708	1,652,081.76	0.31
88	000063	中兴通讯	64,200	1,639,026.00	0.30
89	603986	兆易创新	10,980	1,561,465.80	0.29
90	600111	北方稀土	44,100	1,550,556.00	0.29
91	000661	长春高新	6,600	1,540,572.00	0.29
92	002230	科大讯飞	37,300	1,537,506.00	0.29

93	300142	沃森生物	31,700	1,533,963.00	0.29
94	002371	北方华创	5,400	1,496,448.00	0.28
95	601916	浙商银行	448,900	1,490,348.00	0.28
96	601688	华泰证券	104,800	1,488,160.00	0.28
97	002459	晶澳科技	18,120	1,429,668.00	0.27
98	601628	中国人寿	45,513	1,414,544.04	0.26
99	300450	先导智能	22,200	1,402,596.00	0.26
100	601669	中国电建	177,000	1,392,990.00	0.26
101	601211	国泰君安	91,100	1,384,720.00	0.26
102	601939	建设银行	227,300	1,377,438.00	0.26
103	002027	分众传媒	204,200	1,374,266.00	0.26
104	000100	TCL科技	283,300	1,357,007.00	0.25
105	601169	北京银行	298,800	1,356,552.00	0.25
106	601857	中国石油	254,300	1,347,790.00	0.25
107	601229	上海银行	200,837	1,315,482.35	0.24
108	601985	中国核电	190,100	1,304,086.00	0.24
109	600745	闻泰科技	15,300	1,302,183.00	0.24
110	600050	中国联通	375,300	1,298,538.00	0.24
111	000408	藏格矿业	39,400	1,297,836.00	0.24
112	601766	中国中车	245,500	1,276,600.00	0.24
113	601390	中国中铁	205,700	1,262,998.00	0.23
114	300316	晶盛机电	18,400	1,243,656.00	0.23
115	300347	泰格医药	10,700	1,224,615.00	0.23
116	601998	中信银行	256,600	1,218,850.00	0.23
117	000338	潍柴动力	96,700	1,205,849.00	0.22
118	600660	福耀玻璃	28,605	1,195,975.05	0.22
119	600893	航发动力	26,200	1,192,362.00	0.22
120	600132	重庆啤酒	7,700	1,128,820.00	0.21
121	000776	广发证券	60,000	1,122,000.00	0.21
122	688599	天合光能	17,014	1,110,163.50	0.21
123	600009	上海机场	19,432	1,101,794.40	0.20

124	600958	东方证券	107,819	1,100,831.99	0.20
125	600999	招商证券	75,183	1,083,387.03	0.20
126	600019	宝钢股份	179,800	1,082,396.00	0.20
127	600010	包钢股份	460,000	1,081,000.00	0.20
128	600196	复星医药	24,400	1,075,796.00	0.20
129	002410	广联达	19,100	1,039,804.00	0.19
130	600018	上港集团	177,600	1,035,408.00	0.19
131	300782	卓胜微	7,620	1,028,700.00	0.19
132	300896	爱美客	1,714	1,028,417.14	0.19
133	600570	恒生电子	23,600	1,027,544.00	0.19
134	000895	双汇发展	34,942	1,023,800.60	0.19
135	002311	海大集团	16,790	1,007,567.90	0.19
136	002050	三花智控	36,454	1,001,755.92	0.19
137	002179	中航光电	15,686	993,237.52	0.18
138	000166	申万宏源	224,500	963,105.00	0.18
139	603369	今世缘	18,700	953,700.00	0.18
140	600346	恒力石化	42,660	948,758.40	0.18
141	300661	圣邦股份	5,200	946,504.00	0.18
142	002493	荣盛石化	61,425	945,330.75	0.18
143	002074	国轩高科	20,300	925,680.00	0.17
144	601633	长城汽车	24,700	914,888.00	0.17
145	300496	中科创达	6,900	900,312.00	0.17
146	601336	新华保险	27,700	891,663.00	0.17
147	600460	士兰微	17,100	889,200.00	0.17
148	000538	云南白药	14,640	884,109.60	0.16
149	001979	招商蛇口	64,000	859,520.00	0.16
150	002001	新和成	37,624	858,203.44	0.16
151	601989	中国重工	230,200	854,042.00	0.16
152	000768	中航西飞	28,100	851,149.00	0.16
153	002920	德赛西威	5,600	828,800.00	0.15
154	002202	金风科技	55,800	825,840.00	0.15

155	603993	洛阳钼业	142,600	817,098.00	0.15
156	600763	通策医疗	4,600	802,424.00	0.15
157	000963	华东医药	17,580	793,912.80	0.15
158	601006	大秦铁路	120,000	790,800.00	0.15
159	601138	工业富联	80,200	789,168.00	0.15
160	300751	迈为股份	1,600	785,440.00	0.15
161	300759	康龙化成	8,200	780,804.00	0.15
162	601877	正泰电器	21,700	776,426.00	0.14
163	300207	欣旺达	24,300	767,880.00	0.14
164	601377	兴业证券	108,200	762,810.00	0.14
165	601600	中国铝业	158,500	752,875.00	0.14
166	600600	青岛啤酒	7,200	748,224.00	0.14
167	600029	南方航空	102,300	747,813.00	0.14
168	600085	同仁堂	14,000	740,320.00	0.14
169	600588	用友网络	33,998	738,096.58	0.14
170	601066	中信建投	25,500	737,205.00	0.14
171	601186	中国铁建	92,900	733,910.00	0.14
172	600760	中航沈飞	12,140	733,863.00	0.14
173	600741	华域汽车	31,900	733,700.00	0.14
174	688111	金山办公	3,659	721,262.08	0.13
175	600188	兖矿能源	18,000	710,640.00	0.13
176	603806	福斯特	10,780	706,305.60	0.13
177	600795	国电电力	180,100	704,191.00	0.13
178	601111	中国国航	60,400	701,244.00	0.13
179	000786	北新建材	20,200	699,324.00	0.13
180	300408	三环集团	23,215	698,771.50	0.13
181	000876	新希望	45,500	696,150.00	0.13
182	000792	盐湖股份	23,100	692,076.00	0.13
183	600150	中国船舶	36,200	687,076.00	0.13
184	603019	中科曙光	23,620	685,452.40	0.13
185	600547	山东黄金	36,539	678,163.84	0.13

186	688005	容百科技	5,200	673,088.00	0.13
187	601238	广汽集团	44,100	672,084.00	0.12
188	003816	中国广核	238,200	666,960.00	0.12
189	601800	中国交建	71,200	660,736.00	0.12
190	600989	宝丰能源	44,500	651,925.00	0.12
191	300763	锦浪科技	3,050	649,650.00	0.12
192	601100	恒立液压	10,480	646,825.60	0.12
193	600886	国投电力	60,400	634,200.00	0.12
194	000596	古井贡酒	2,536	633,137.76	0.12
195	002648	卫星化学	24,274	627,482.90	0.12
196	600011	华能国际	88,800	625,152.00	0.12
197	600383	金地集团	46,300	622,272.00	0.12
198	601868	中国能建	261,800	620,466.00	0.12
199	000157	中联重科	100,200	617,232.00	0.11
200	000301	东方盛虹	36,100	610,451.00	0.11
201	601788	光大证券	38,700	609,912.00	0.11
202	600115	中国东航	110,700	607,743.00	0.11
203	300601	康泰生物	13,260	599,086.80	0.11
204	002236	大华股份	36,400	597,688.00	0.11
205	000425	徐工机械	110,700	596,673.00	0.11
206	300595	欧普康视	10,400	594,776.00	0.11
207	601117	中国化学	62,300	586,243.00	0.11
208	603486	科沃斯	4,700	572,883.00	0.11
209	002008	大族激光	17,100	566,523.00	0.11
210	000938	紫光股份	28,962	561,862.80	0.10
211	688012	中微公司	4,800	560,400.00	0.10
212	601901	方正证券	83,200	558,272.00	0.10
213	002736	国信证券	58,300	557,931.00	0.10
214	603833	欧派家居	3,700	557,516.00	0.10
215	300628	亿联网络	7,300	555,895.00	0.10
216	600941	中国移动	9,100	550,550.00	0.10

217	688008	澜起科技	8,987	544,432.46	0.10
218	000069	华侨城 A	82,800	537,372.00	0.10
219	600352	浙江龙盛	52,500	534,450.00	0.10
220	600219	南山铝业	143,000	527,670.00	0.10
221	601799	星宇股份	3,000	513,000.00	0.10
222	002841	视源股份	6,800	512,176.00	0.10
223	300413	芒果超媒	15,300	510,408.00	0.09
224	002007	华兰生物	22,175	505,590.00	0.09
225	601618	中国中冶	144,200	504,700.00	0.09
226	300529	健帆生物	9,800	498,722.00	0.09
227	603185	上机数控	3,160	492,928.40	0.09
228	601360	三六零	57,600	490,752.00	0.09
229	002601	龙佰集团	24,400	489,220.00	0.09
230	300999	金龙鱼	9,000	486,180.00	0.09
231	002252	上海莱士	81,600	483,888.00	0.09
232	300003	乐普医疗	25,500	473,535.00	0.09
233	000703	恒逸石化	44,463	467,306.13	0.09
234	601155	新城控股	18,200	462,826.00	0.09
235	300454	深信服	4,400	456,632.00	0.08
236	600332	白云山	14,423	455,622.57	0.08
237	300433	蓝思科技	40,100	443,907.00	0.08
238	002602	世纪华通	90,340	435,438.80	0.08
239	600489	中金黄金	58,800	434,532.00	0.08
240	300033	同花顺	4,500	432,675.00	0.08
241	601021	春秋航空	7,400	431,790.00	0.08
242	600918	中泰证券	56,200	429,930.00	0.08
243	002938	鹏鼎控股	14,200	428,982.00	0.08
244	000066	中国长城	39,100	423,062.00	0.08
245	603899	晨光股份	7,509	421,104.72	0.08
246	688036	传音控股	4,700	419,381.00	0.08
247	300223	北京君正	3,900	414,375.00	0.08

248	000708	中信特钢	20,500	413,075.00	0.08
249	603260	合盛硅业	3,500	412,860.00	0.08
250	002120	韵达股份	23,762	405,379.72	0.08
251	600183	生益科技	23,400	397,566.00	0.07
252	601865	福莱特	10,400	396,240.00	0.07
253	002916	深南电路	4,220	395,456.20	0.07
254	688126	沪硅产业	16,917	388,752.66	0.07
255	603290	斯达半导	1,000	385,900.00	0.07
256	600845	宝信软件	7,060	385,476.00	0.07
257	601898	中煤能源	37,100	385,098.00	0.07
258	600362	江西铜业	21,100	376,213.00	0.07
259	601878	浙商证券	31,800	361,884.00	0.07
260	601728	中国电信	95,100	354,723.00	0.07
261	002414	高德红外	26,536	341,518.32	0.06
262	600161	天坛生物	14,000	339,920.00	0.06
263	601216	君正集团	68,200	332,816.00	0.06
264	688396	华润微	5,600	330,792.00	0.06
265	600061	国投资本	51,815	329,543.40	0.06
266	002791	坚朗五金	2,500	324,300.00	0.06
267	002568	百润股份	10,720	322,028.80	0.06
268	688169	石头科技	500	308,350.00	0.06
269	601995	中金公司	6,900	306,981.00	0.06
270	600606	绿地控股	77,375	306,405.00	0.06
271	601966	玲珑轮胎	11,800	299,366.00	0.06
272	600655	豫园股份	31,500	297,360.00	0.06
273	688561	奇安信	5,300	295,740.00	0.05
274	603160	汇顶科技	4,700	291,071.00	0.05
275	002600	领益智造	56,900	285,638.00	0.05
276	688065	凯赛生物	2,400	268,320.00	0.05
277	600025	华能水电	36,400	254,436.00	0.05
278	601881	中国银河	26,100	252,387.00	0.05

279	002064	华峰化学	29,100	245,604.00	0.05
280	688363	华熙生物	1,727	245,544.86	0.05
281	300957	贝泰妮	1,100	239,283.00	0.04
282	603195	公牛集团	1,500	229,365.00	0.04
283	300866	安克创新	3,300	218,856.00	0.04
284	002607	中公教育	37,500	217,125.00	0.04
285	002032	苏泊尔	3,300	185,922.00	0.03
286	603087	甘李药业	3,700	177,489.00	0.03
287	000800	一汽解放	18,300	170,922.00	0.03
288	601808	中海油服	12,100	168,795.00	0.03
289	601236	红塔证券	18,300	167,079.00	0.03
290	605499	东鹏饮料	900	153,774.00	0.03
291	000877	天山股份	11,900	146,370.00	0.03
292	300919	中伟股份	1,100	136,290.00	0.03
293	601825	沪农商行	20,600	129,162.00	0.02
294	300979	华利集团	1,600	116,928.00	0.02
295	601698	中国卫通	8,700	98,397.00	0.02
296	001289	龙源电力	3,100	67,456.00	0.01

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	600256	广汇能源	145,800	1,536,732.00	0.29
2	600938	中国海油	87,502	1,460,126.72	0.27
3	000733	振华科技	10,100	1,373,297.00	0.26
4	601231	环旭电子	65,700	943,452.00	0.18
5	601933	永辉超市	119,600	511,888.00	0.10
6	688297	中无人机	8,715	399,844.20	0.07
7	688349	三一重能	8,423	343,237.25	0.06
8	688238	和元生物	12,836	325,007.52	0.06

9	688045	必易微	3,939	264,622.02	0.05
10	300558	贝达药业	4,100	249,280.00	0.05
11	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.04
12	301109	军信股份	9,496	161,710.14	0.03
13	301216	万凯新材	4,331	135,883.81	0.03
14	688282	理工导航	2,548	122,227.56	0.02
15	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.02
16	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
17	600177	雅戈尔	8,900	59,007.00	0.01
18	301238	瑞泰新材	1,372	44,000.04	0.01
19	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
20	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.00
21	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.00
22	301302	华如科技	407	22,962.94	0.00
23	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
24	001228	永泰运	383	20,739.45	0.00
25	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
26	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
27	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
28	301150	中一科技	189	15,641.64	0.00
29	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
30	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
31	301236	软通动力	416	13,054.08	0.00
32	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
33	301103	何氏眼科	377	12,071.54	0.00
34	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
35	301102	兆讯传媒	344	10,694.96	0.00
36	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
37	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
38	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
39	301219	腾远钴业	101	8,869.82	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	600519	贵州茅台	17,167,376.00	6.49
2	300750	宁德时代	11,574,606.00	4.37
3	600036	招商银行	8,544,072.60	3.23
4	601318	中国平安	7,049,262.00	2.66
5	002466	天齐锂业	5,789,389.00	2.19
6	601012	隆基绿能	4,662,534.60	1.76
7	600030	中信证券	4,652,999.50	1.76
8	603259	药明康德	4,474,873.00	1.69
9	600809	山西汾酒	4,404,365.00	1.66
10	000001	平安银行	4,288,471.00	1.62
11	002460	赣锋锂业	4,145,030.00	1.57
12	000858	五粮液	4,107,089.00	1.55
13	000333	美的集团	3,735,233.00	1.41
14	600900	长江电力	3,399,199.42	1.28
15	600089	特变电工	3,349,414.00	1.27
16	600887	伊利股份	3,159,497.00	1.19
17	000568	泸州老窖	3,150,110.24	1.19
18	601899	紫金矿业	3,149,372.00	1.19
19	600426	华鲁恒升	3,023,946.00	1.14
20	600905	三峡能源	2,963,909.00	1.12

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	002466	天齐锂业	4,261,545.00	1.61

2	300750	宁德时代	3,487,270.00	1.32
3	603259	药明康德	2,925,056.00	1.11
4	600887	伊利股份	1,958,807.00	0.74
5	300014	亿纬锂能	1,865,565.00	0.70
6	600011	华能国际	1,856,821.00	0.70
7	600519	贵州茅台	1,675,563.00	0.63
8	600036	招商银行	1,608,529.00	0.61
9	600795	国电电力	1,534,826.00	0.58
10	002460	赣锋锂业	1,501,321.00	0.57
11	300347	泰格医药	1,499,667.00	0.57
12	601238	广汽集团	1,480,911.00	0.56
13	600809	山西汾酒	1,444,030.00	0.55
14	000333	美的集团	1,368,292.00	0.52
15	300015	爱尔眼科	1,307,480.16	0.49
16	603517	绝味食品	1,261,592.00	0.48
17	600406	国电南瑞	1,136,122.00	0.43
18	600233	圆通速递	1,125,142.00	0.43
19	600460	士兰微	1,122,099.00	0.42
20	601888	中国中免	1,090,660.00	0.41

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	364,457,499.16
卖出股票收入（成交）总额	90,030,790.24

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	13,117,588.49	2.44

2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,655.40	0.01
	其中：政策性金融债	30,655.40	0.01
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	13,148,243.89	2.44

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	019666	22国债01	129,720	13,117,588.49	2.44
2	018010	国开1902	300	30,655.40	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 中信证券（代码：600030.SH）为本基金前十大持仓证券。2022年6月10日，公司收到中国证监会《关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（行政监管措施[2022]29号），公司存在以下违规行为：一是2015年设立中信证券海外投资有限公司，未按照当时《证券法》第一百二十九条的规定报证监会批准；二是未按期完成境外子公司股权架构调整工作，存在控股平台下设控股平台、专业子公司下设专业子公司、特殊目的实体（SPV）下设子公司、股权架构层级多达8层等问题；三是存在境外子公司从事房地产基金管理非金融相关业务和返程子公司从事咨询、研究等业务的问题。公司上述行为违反了《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》，中国证监会责令公司改正，并要求公司向深圳证监局提交整改报告。

本基金投资中信证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除中信证券之外，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。

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	71,098.65
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,045,622.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,116,720.75

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	600938	中国海油	666,151.72	0.12	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
85,569	4,312.89	102,616,090.90	27.81%	266,433,530.10	72.19%

注：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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	96,839.91	0.03%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研部	0

门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年02月28日)基金份额总额	205,770,647.89
本报告期期初基金份额总额	167,855,634.21
本报告期基金总申购份额	379,366,060.14
减：本报告期基金总赎回份额	178,172,073.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	369,049,620.93

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

2022年1月18日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司董事变动情况的公告》，经公司唯一股东中国人保集团股份有限公司决定，并报中国银行保险监督管理委员会核准同意，中国人保资产管理有限公司第四届董事会成立，人员组成如下：罗熹、秦岭任公司第四届董事会非执行董事；曾北川、黄本尧任公司第四届董事会执行董事；索绪权、王长华、丛林任公司第四届董事会独立董事。与此同时，张巍不再担任我公司非执行董事，郑洪涛、叶永刚不再担任我公司独立董事。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

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

本基金自成立之日起至今聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务, 本报告期内未发生变动。

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

本报告期内, 北京证监局根据对我公司的检查情况出具了监管措施。公司高度重视, 及时向监管机构提交整改报告, 采取相应的改进措施。

基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	263,570,743.03	59.04%	192,750.15	59.04%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	182,827,837.65	40.96%	133,702.13	40.96%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

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
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	13,029,502.20	100.00%	2,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-05
2	中国人保资产管理有限公司董事变动情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-18
3	关于旗下部分基金参与中国人寿保险股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-24
4	中国人保资产管理有限公司旗下基金2021年4季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-24
5	人保沪深300指数型证券投资基金2021年第四季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-24
6	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	2022-03-29
7	人保沪深300指数型证券投资基金招募	中国证监会规定	2022-03-29

	说明书更新(2022年第1号)	报刊及网站	
8	人保沪深300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	2022-03-29
9	关于旗下部分基金2021年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-31
10	人保沪深300指数型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-31
11	关于旗下部分基金2022年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-22
12	人保沪深300指数型证券投资基金2022年第一季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-22
13	中国人保资产管理有限公司关于营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-26
14	关于旗下基金2022年2季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-07-20
15	人保沪深300指数型证券投资基金2022年第二季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022-07-20
16	关于旗下基金在部分销售机构暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-07-20

§ 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	20220101 - 20220216	50,667,815.16	0.00	0.00	50,667,815.16	13.73%
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</p>							

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指定报刊上披露的各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区西长安街88号中国人保大厦

基金托管人地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

二〇二二年八月三十日