

人保中证 500 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	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	62
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	62
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	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 投资组合报告附注	62
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65

§9 开放式基金份额变动.....	65
§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.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	人保中证500指数型证券投资基金
基金简称	人保中证500
基金主代码	006611
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月07日
基金管理人	中国人保资产管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,821,026.04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，紧密跟踪中证500指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资策略	本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中国人保资产管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吕传红	陆志俊
	联系电话	010-69009696	95559
	电子邮箱	lvch@piccamc.com	luzj@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	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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	fund.piccamc.com
基金中期报告备置地点	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	-2,830,430.52
加权平均基金份额本期利润	-0.1202
本期加权平均净值利润率	-7.87%
本期基金份额净值增长率	-10.55%
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	18,728,284.00
期末可供分配基金份额利润	0.5706
期末基金资产净值	51,549,310.04
期末基金份额净值	1.5706
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	57.06%

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	7.35%	1.02%	6.74%	1.05%	0.61%	-0.03%
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份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

人保中证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中证500指数的被动指数产品，基金管理人将运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保中证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-10.55%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

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

本报告期内，因赎回等原因，本基金自2022年1月1日至2022年6月28日连续115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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在人保中证500指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，人保资产管理有限公司在人保中证500指数型证券投资基金投资基金投资运作、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，由人保资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关人保中证500指数型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

报告截止日：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	3,547,075.85	3,262,694.56
结算备付金		6,227.54	2,275.61
存出保证金		6,041.25	806.91
交易性金融资产	6.4.7.2	48,633,892.03	40,680,911.45
其中：股票投资		47,625,702.41	40,680,911.45
基金投资		-	-
债券投资		1,008,189.62	-
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		-	45,102.12
应收股利		-	-
应收申购款		1,838,617.67	66,811.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	835.52
资产总计		54,031,854.34	44,059,437.68
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		1,619,098.10	-
应付赎回款		629,302.88	98,564.02
应付管理人报酬		16,319.76	16,477.44
应付托管费		3,626.61	3,661.67
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	214,196.95	189,294.50
负债合计		2,482,544.30	307,997.63
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	32,821,026.04	24,917,975.70
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	18,728,284.00	18,833,464.35
净资产合计		51,549,310.04	43,751,440.05
负债和净资产总计		54,031,854.34	44,059,437.68

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额32,821,026.04份，份额净值1.5706元。

6.2 利润表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：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	上年度可比期间
		2022年01月 01日至2022 年06月30 日	2021年01月01日至2021 年06月30日
一、营业总收入		-2,592,72 4.13	3,391,264.58

1. 利息收入		8,167.21	22,336.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,153.21	3,527.15
债券利息收入		-	18,809.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14.00	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,427,445.70	4,590,350.89
其中：股票投资收益	6.4.7.10	957,628.90	4,261,442.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	8,086.99	-4,102.22
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	461,729.81	333,010.51
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	-4,047,465.80	-1,237,011.95
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	19,128.76	15,588.72
减：二、营业总支出		237,706.39	312,587.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	79,764.45	89,675.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,725.36	19,927.84

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	140, 216. 58	202, 983. 87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2, 830, 43 0. 52	3, 078, 677. 37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2, 830, 43 0. 52	3, 078, 677. 37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2, 830, 43 0. 52	3, 078, 677. 37

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：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）	24, 917, 97 5. 70	-	18, 833, 464. 3 5	43, 751, 440. 0 5
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基	24, 917, 97	-	18, 833, 464. 3	43, 751, 440. 0

金净值)	5.70		5	5
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,903,050.34	-	-105,180.35	7,797,869.99
(一)、综合收益总额	-	-	-2,830,430.52	-2,830,430.52
(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)	7,903,050.34	-	2,725,250.17	10,628,300.51
其中: 1. 基金申购款	24,824,471.47	-	12,542,987.59	37,367,459.06
2. 基金赎回款	-16,921,421.13	-	-9,817,737.42	-26,739,158.55
(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)	32,821,026.04	-	18,728,284.00	51,549,310.04
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)	29,742,545.77	-	15,278,522.32	45,021,068.09
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)	29,742,545.77	-	15,278,522.32	45,021,068.09
三、本期增减变动额(减	-4,853,14	-	349,805.80	-4,503,336.4

少以“-”号填列)	2.27			7
(一)、综合收益总额	-	-	3,078,677.37	3,078,677.37
(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)	-4,853,142.27	-	-2,728,871.57	-7,582,013.84
其中: 1. 基金申购款	8,709,741.77	-	4,701,716.66	13,411,458.43
2. 基金赎回款	-13,562,884.04	-	-7,430,588.23	-20,993,472.27
(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)	24,889,403.50	-	15,628,328.12	40,517,731.62

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

人保中证500指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人中国人保资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《人保中证500指数型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]1723号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为255,386,460.94份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第00367号验资报告。基金合同于2018年12月7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、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权需缴纳的现金保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

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	3,547,075.85
等于：本金	3,546,439.57
加：应计利息	636.28
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	3,547,075.85

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	46,504,139.86	-	47,625,702.41	1,121,562.55	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	999,093.70	9,694.12	1,008,189.62	-598.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	999,093.70	9,694.12	1,008,189.62	-598.20
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	47,503,233.56	9,694.12	48,633,892.03	1,120,964.35	

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	2,277.54	
应付证券出借违约金	-	
应付交易费用	22,247.83	
其中：交易所市场	22,247.83	
银行间市场	-	
应付利息	-	
预提费用	39,671.58	
其他应付	150,000.00	
合计	214,196.95	

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	24,917,975.70	24,917,975.70
本期申购	24,824,471.47	24,824,471.47
本期赎回（以“-”号填列）	-16,921,421.13	-16,921,421.13
本期末	32,821,026.04	32,821,026.04

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	27,114,991.88	-8,281,527.53	18,833,464.35
本期利润	1,217,035.28	-4,047,465.80	-2,830,430.52

本期基金份额交易产生的变动数	9,356,658.50	-6,631,408.33	2,725,250.17
其中：基金申购款	28,248,186.94	-15,705,199.35	12,542,987.59
基金赎回款	-18,891,528.44	9,073,791.02	-9,817,737.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,688,685.66	-18,960,401.66	18,728,284.00

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	7,885.97	
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	233.67	
其他	33.57	
合计	8,153.21	

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	18,553,248.63	
减：卖出股票成本总额	17,538,755.03	
减：交易费用	56,864.70	
买卖股票差价收入	957,628.90	

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	8,087.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1.00
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	8,086.99

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	1.00
买卖债券差价收入	-1.00

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
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	461,729.81
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	461,729.81

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-4,047,465.80
——股票投资	-4,046,867.60
——债券投资	-598.20
——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	-4,047,465.80

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	19,128.76
合计	19,128.76

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	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
汇划手续费	545.00
其他费用_指数使用费	100,000.00
合计	140,216.58

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	79,764.45	89,675.50
其中：支付销售机构的客户维护费	32,775.71	27,819.43

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	17,725.36	19,927.84

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（2018年12月07日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	7,199,000.00	7,199,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	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	7,199,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	7,199,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	28.92%

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

本报告期内无除基金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 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	3,547,075.85	7,885.97	942,090.11	3,266.41

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

002 670	国 盛 金 控	202 2-0 6-0 1	筹划公 司控股 股东及 实际控 制人变 更	9. 60	2022- 07-14	9.99	7,000	74,805. 00	67,20 0.00	-
------------	------------------	------------------------	--------------------------------------	----------	----------------	------	-------	---------------	---------------	---

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	3,547,075.85	-	-	-	3,547,075.85
结算备付金	6,227.54	-	-	-	6,227.54
存出保证金	6,041.25	-	-	-	6,041.25
交易性金融资产	1,008,189.62	-	-	47,625,702.41	48,633,892.03
应收申购款	-	-	-	1,838,617.67	1,838,617.67
资产总计	4,567,534.26	-	-	49,464,320.08	54,031,854.34
负债					
应付清算款	-	-	-	1,619,098.10	1,619,098.10
应付赎回款	-	-	-	629,302.88	629,302.88
应付管理人报酬	-	-	-	16,319.76	16,319.76
应付托管费	-	-	-	3,626.61	3,626.61
其他负债	-	-	-	214,196.95	214,196.95
负债总计	-	-	-	2,482,544.30	2,482,544.30
利率敏感度缺口	4,567,534.26	-	-	46,981,775.78	51,549,310.04
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	3,262,694.56	-	-	-	3,262,694.56
结算备付金	2,275.61	-	-	-	2,275.61
存出保证金	806.91	-	-	-	806.91
交易性金融资产	-	-	-	40,680,911.45	40,680,911.45
应收证券清算款	-	-	-	45,102.12	45,102.12
应收申购款	-	-	-	66,811.51	66,811.51
其他资产	-	-	-	835.52	835.52
资产总计	3,265,777.08	-	-	40,793,660.60	44,059,437.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	98,564.02	98,564.02
应付管理人报酬	-	-	-	16,477.44	16,477.44
应付托管费	-	-	-	3,661.67	3,661.67
其他负债	-	-	-	189,294.50	189,294.50
负债总计	-	-	-	307,997.63	307,997.63
利率敏感度缺口	3,265,777.08	-	-	40,485,662.97	43,751,440.05

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	-1,334.83	-
2. 市场利率下降25个基点	1,339.89	-	

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	47,625,702.41	92.39	40,680,911.45	92.98
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	-	-	-	-

一 贵金属投资				
衍生金融资产— 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,625,702.41	92.39	40,680,911.45	92.98

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%	2,428,428.56	1,899,731.79
	2. 业绩比较基准减少5%	-2,428,428.56	-1,899,731.79

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	47,558,502.41	40,574,999.09
第二层次	1,075,389.62	105,912.36

第三层次	-	-
合计	48,633,892.03	40,680,911.45

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	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	其他各项资产	1,844,658.92	3.41
9	合计	54,031,854.34	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	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
--	----	---------------	-------

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	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

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	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
11	600157	永泰能源	172,200	273,798.00	0.53
12	002180	纳思达	5,400	273,348.00	0.53
13	600141	兴发集团	6,100	268,339.00	0.52
14	000009	中国宝安	19,200	259,008.00	0.50
15	603613	国联股份	2,875	254,725.00	0.49
16	300073	当升科技	2,800	252,952.00	0.49
17	600392	盛和资源	11,100	250,860.00	0.49
18	300390	天华超净	2,800	244,720.00	0.47
19	002384	东山精密	10,500	240,765.00	0.47
20	002407	多氟多	4,900	239,659.00	0.46
21	002756	永兴材料	1,500	228,315.00	0.44
22	600765	中航重机	6,980	224,616.40	0.44
23	300285	国瓷材料	6,200	222,704.00	0.43
24	600885	宏发股份	5,320	222,642.00	0.43
25	600233	圆通速递	10,600	216,134.00	0.42
26	601555	东吴证券	31,160	215,938.80	0.42
27	000983	山西焦煤	15,870	212,499.30	0.41
28	600487	亨通光电	14,600	212,284.00	0.41

29	600732	爱旭股份	6,400	211,328.00	0.41
30	688180	君实生物	2,800	210,952.00	0.41
31	300037	新宙邦	4,000	210,240.00	0.41
32	600399	抚顺特钢	11,700	209,430.00	0.41
33	600499	科达制造	10,100	208,464.00	0.40
34	600418	江淮汽车	12,100	207,636.00	0.40
35	603077	和邦生物	47,900	204,054.00	0.40
36	300363	博腾股份	2,600	202,774.00	0.39
37	688099	晶晨股份	2,000	202,000.00	0.39
38	603456	九洲药业	3,900	201,630.00	0.39
39	002385	大北农	25,700	200,717.00	0.39
40	002268	卫士通	4,500	193,095.00	0.37
41	601058	赛轮轮胎	17,000	191,590.00	0.37
42	600298	安琪酵母	3,900	190,125.00	0.37
43	000519	中兵红箭	6,400	186,560.00	0.36
44	300144	宋城演艺	12,100	185,735.00	0.36
45	600563	法拉电子	900	184,644.00	0.36
46	601077	渝农商行	49,200	182,040.00	0.35
47	000630	铜陵有色	54,700	178,322.00	0.35
48	000783	长江证券	29,900	177,307.00	0.34
49	600862	中航高科	6,300	177,030.00	0.34
50	000988	华工科技	7,500	173,775.00	0.34
51	603517	绝味食品	3,000	173,460.00	0.34
52	600486	扬农化工	1,300	173,264.00	0.34
53	600153	建发股份	13,100	171,217.00	0.33
54	603589	口子窖	2,900	169,969.00	0.33
55	002353	杰瑞股份	4,200	169,260.00	0.33
56	601168	西部矿业	14,200	167,986.00	0.33
57	002797	第一创业	26,000	166,660.00	0.32
58	000932	华菱钢铁	32,180	163,796.20	0.32
59	002185	华天科技	17,400	163,212.00	0.32

60	002056	横店东磁	6,100	162,382.00	0.32
61	002603	以岭药业	6,660	161,838.00	0.31
62	002625	光启技术	9,300	160,611.00	0.31
63	002028	思源电气	4,500	160,470.00	0.31
64	600521	华海药业	7,000	158,900.00	0.31
65	601636	旗滨集团	12,400	158,100.00	0.31
66	600109	国金证券	17,400	156,600.00	0.30
67	601607	上海医药	8,600	155,488.00	0.30
68	603939	益丰药房	2,900	153,207.00	0.30
69	600988	赤峰黄金	9,600	153,120.00	0.30
70	300699	光威复材	2,600	153,062.00	0.30
71	002078	太阳纸业	12,400	152,644.00	0.30
72	300724	捷佳伟创	1,700	151,895.00	0.29
73	002326	永太科技	4,500	148,185.00	0.29
74	600546	山煤国际	7,600	147,896.00	0.29
75	601696	中银证券	11,100	147,630.00	0.29
76	300146	汤臣倍健	6,800	147,220.00	0.29
77	603605	珀莱雅	880	145,358.40	0.28
78	603026	石大胜华	1,000	145,350.00	0.28
79	002557	洽洽食品	2,552	145,285.36	0.28
80	000830	鲁西化工	8,400	145,236.00	0.28
81	002507	涪陵榨菜	4,200	144,984.00	0.28
82	600549	厦门钨业	6,700	144,854.00	0.28
83	600348	华阳股份	9,300	143,778.00	0.28
84	000728	国元证券	23,100	143,682.00	0.28
85	600705	中航产融	41,500	143,590.00	0.28
86	601990	南京证券	17,200	143,448.00	0.28
87	300676	华大基因	2,000	143,400.00	0.28
88	000970	中科三环	7,600	142,728.00	0.28
89	600497	驰宏锌锗	27,500	142,725.00	0.28
90	600875	东方电气	8,600	141,470.00	0.27

91	000831	五矿稀土	4,500	140,625.00	0.27
92	000738	航发控制	5,000	140,500.00	0.27
93	605117	德业股份	500	139,945.00	0.27
94	000999	华润三九	3,100	139,500.00	0.27
95	601872	招商轮船	24,100	138,816.00	0.27
96	600160	巨化股份	10,441	137,299.15	0.27
97	002673	西部证券	20,900	136,686.00	0.27
98	600177	雅戈尔	20,600	136,578.00	0.26
99	002572	索菲亚	4,925	135,437.50	0.26
100	300357	我武生物	2,600	135,278.00	0.26
101	300088	长信科技	18,200	135,044.00	0.26
102	600516	方大炭素	17,700	134,520.00	0.26
103	601699	潞安环能	9,200	134,504.00	0.26
104	002508	老板电器	3,700	133,311.00	0.26
105	002409	雅克科技	2,400	133,224.00	0.26
106	000039	中集集团	9,580	132,683.00	0.26
107	002624	完美世界	9,200	132,204.00	0.26
108	688390	固德威	420	131,464.20	0.26
109	601997	贵阳银行	22,600	131,306.00	0.25
110	600482	中国动力	8,300	130,393.00	0.25
111	002030	达安基因	7,573	130,179.87	0.25
112	002465	海格通信	14,300	129,987.00	0.25
113	000998	隆平高科	7,800	129,948.00	0.25
114	002138	顺络电子	4,700	128,075.00	0.25
115	000807	云铝股份	12,919	127,639.72	0.25
116	300308	中际旭创	4,100	127,305.00	0.25
117	002422	科伦药业	6,800	127,160.00	0.25
118	600143	金发科技	13,300	126,616.00	0.25
119	000629	攀钢钒钛	33,300	126,540.00	0.25
120	300136	信维通信	7,500	126,375.00	0.25
121	300058	蓝色光标	19,300	126,029.00	0.24

122	000960	锡业股份	7,500	125,775.00	0.24
123	000975	银泰黄金	12,860	125,256.40	0.24
124	603127	昭衍新药	1,100	125,180.00	0.24
125	600536	中国软件	3,070	124,611.30	0.24
126	600039	四川路桥	11,800	124,254.00	0.24
127	600704	物产中大	24,200	124,146.00	0.24
128	600079	人福医药	7,600	121,600.00	0.24
129	603267	鸿远电子	900	120,897.00	0.23
130	002936	郑州银行	44,600	119,974.00	0.23
131	600315	上海家化	2,800	119,700.00	0.23
132	600739	辽宁成大	8,200	119,556.00	0.23
133	002223	鱼跃医疗	4,650	119,319.00	0.23
134	300418	昆仑万维	7,400	118,400.00	0.23
135	000636	风华高科	6,300	118,377.00	0.23
136	000547	航天发展	9,881	117,979.14	0.23
137	601162	天风证券	37,100	117,978.00	0.23
138	600415	小商品城	21,100	117,527.00	0.23
139	603345	安井食品	700	117,509.00	0.23
140	002739	万达电影	8,600	117,390.00	0.23
141	300832	新产业	2,600	117,286.00	0.23
142	603198	迎驾贡酒	1,800	117,252.00	0.23
143	600699	均胜电子	7,440	116,882.40	0.23
144	300253	卫宁健康	13,300	116,774.00	0.23
145	603444	吉比特	300	116,400.00	0.23
146	600867	通化东宝	11,200	115,808.00	0.22
147	300558	贝达药业	1,900	115,520.00	0.22
148	002372	伟星新材	4,800	115,392.00	0.22
149	300296	利亚德	15,800	115,340.00	0.22
150	600859	王府井	4,400	114,312.00	0.22
151	600637	东方明珠	15,900	113,685.00	0.22
152	600038	中直股份	2,500	113,000.00	0.22

153	300474	景嘉微	1,650	112,843.50	0.22
154	600372	中航电子	5,800	112,462.00	0.22
155	601016	节能风电	23,300	111,840.00	0.22
156	002506	协鑫集成	30,000	111,600.00	0.22
157	600236	桂冠电力	18,300	111,447.00	0.22
158	002092	中泰化学	14,300	110,968.00	0.22
159	002156	通富微电	7,200	110,880.00	0.22
160	601198	东兴证券	12,400	110,360.00	0.21
161	002273	水晶光电	8,998	108,965.78	0.21
162	300244	迪安诊断	3,500	108,850.00	0.21
163	600642	申能股份	19,023	108,050.64	0.21
164	000729	燕京啤酒	11,100	107,226.00	0.21
165	000750	国海证券	29,500	107,085.00	0.21
166	600026	中远海能	10,300	106,399.00	0.21
167	600985	淮北矿业	7,249	105,545.44	0.20
168	600673	东阳光	11,700	105,183.00	0.20
169	000513	丽珠集团	2,900	105,009.00	0.20
170	600258	首旅酒店	4,220	104,656.00	0.20
171	600879	航天电子	16,100	104,489.00	0.20
172	600580	卧龙电驱	7,200	103,824.00	0.20
173	601717	郑煤机	7,200	103,752.00	0.20
174	002439	启明星辰	5,200	103,636.00	0.20
175	002299	圣农发展	5,400	103,572.00	0.20
176	300026	红日药业	13,450	103,565.00	0.20
177	000887	中鼎股份	5,670	103,420.80	0.20
178	600170	上海建工	34,000	103,020.00	0.20
179	000623	吉林敖东	6,918	102,109.68	0.20
180	600369	西南证券	25,700	102,029.00	0.20
181	002131	利欧股份	52,400	101,656.00	0.20
182	600166	福田汽车	35,800	101,314.00	0.20
183	300017	网宿科技	18,900	101,304.00	0.20

184	300383	光环新网	9,700	101,074.00	0.20
185	603568	伟明环保	3,020	100,777.40	0.20
186	600848	上海临港	7,400	100,344.00	0.19
187	002683	广东宏大	3,600	100,188.00	0.19
188	600316	洪都航空	3,300	99,792.00	0.19
189	002195	二三四五	44,350	99,787.50	0.19
190	600027	华电国际	25,300	99,429.00	0.19
191	002203	海亮股份	8,607	99,410.85	0.19
192	600909	华安证券	21,820	99,281.00	0.19
193	601005	重庆钢铁	51,900	99,129.00	0.19
194	600062	华润双鹤	3,860	99,047.60	0.19
195	600008	首创环保	34,100	98,890.00	0.19
196	688521	芯原股份	2,000	98,800.00	0.19
197	002294	信立泰	3,500	98,350.00	0.19
198	600529	山东药玻	3,500	97,825.00	0.19
199	002065	东华软件	15,400	97,328.00	0.19
200	002430	杭氧股份	3,100	96,906.00	0.19
201	300482	万孚生物	2,380	96,889.80	0.19
202	603218	日月股份	3,800	96,520.00	0.19
203	002500	山西证券	16,700	95,858.00	0.19
204	002926	华西证券	12,200	95,648.00	0.19
205	002966	苏州银行	15,610	95,221.00	0.18
206	600171	上海贝岭	3,800	95,114.00	0.18
207	603233	大参林	3,000	93,900.00	0.18
208	600325	华发股份	12,400	93,868.00	0.18
209	600380	健康元	7,600	93,860.00	0.18
210	300618	寒锐钴业	1,600	92,672.00	0.18
211	000825	太钢不锈	17,000	92,650.00	0.18
212	000027	深圳能源	14,420	92,432.20	0.18
213	600820	隧道股份	15,100	92,412.00	0.18
214	000878	云南铜业	8,109	92,361.51	0.18

215	600863	内蒙华电	25,300	92,345.00	0.18
216	002444	巨星科技	4,900	92,316.00	0.18
217	600208	新湖中宝	33,400	92,184.00	0.18
218	601866	中远海发	30,700	92,100.00	0.18
219	600801	华新水泥	4,700	91,697.00	0.18
220	002250	联化科技	5,600	91,672.00	0.18
221	000739	普洛药业	4,400	90,816.00	0.18
222	688009	中国通号	20,000	90,600.00	0.18
223	601577	长沙银行	11,400	90,402.00	0.18
224	300024	机器人	8,900	89,712.00	0.17
225	600271	航天信息	8,200	89,708.00	0.17
226	002183	怡亚通	12,440	89,692.40	0.17
227	601992	金隅集团	32,300	89,471.00	0.17
228	002958	青农商行	26,900	89,308.00	0.17
229	000778	新兴铸管	18,500	89,170.00	0.17
230	300677	英科医疗	3,500	88,760.00	0.17
231	000060	中金岭南	19,900	88,754.00	0.17
232	000050	深天马 A	8,900	88,733.00	0.17
233	002249	大洋电机	14,400	88,416.00	0.17
234	600118	中国卫星	4,400	88,352.00	0.17
235	002831	裕同科技	2,989	88,324.95	0.17
236	603658	安图生物	1,800	88,002.00	0.17
237	002408	齐翔腾达	10,740	87,101.40	0.17
238	600998	九州通	7,300	86,943.00	0.17
239	603156	养元饮品	3,800	86,336.00	0.17
240	000401	冀东水泥	8,200	86,264.00	0.17
241	600066	宇通客车	9,900	85,635.00	0.17
242	600667	太极实业	11,600	85,608.00	0.17
243	002152	广电运通	9,200	85,284.00	0.17
244	000021	深科技	7,300	84,972.00	0.16
245	002212	天融信	8,264	83,879.60	0.16

246	300182	捷成股份	15,205	83,627.50	0.16
247	300009	安科生物	8,256	83,468.16	0.16
248	688002	睿创微纳	2,100	83,412.00	0.16
249	300001	特锐德	4,800	83,088.00	0.16
250	002373	千方科技	7,400	82,288.00	0.16
251	603712	七一二	2,600	81,900.00	0.16
252	600056	中国医药	5,520	81,806.40	0.16
253	600755	厦门国贸	10,900	81,750.00	0.16
254	002396	星网锐捷	3,600	81,504.00	0.16
255	300070	碧水源	15,600	81,276.00	0.16
256	000400	许继电气	4,200	80,640.00	0.16
257	002244	滨江集团	9,300	80,445.00	0.16
258	600511	国药股份	3,000	80,340.00	0.16
259	600390	五矿资本	16,400	80,196.00	0.16
260	603707	健友股份	2,840	80,088.00	0.16
261	000997	新大陆	6,050	79,920.50	0.16
262	002128	电投能源	5,580	79,905.60	0.16
263	688185	康希诺	400	79,632.00	0.15
264	600528	中铁工业	9,800	78,890.00	0.15
265	600566	济川药业	2,900	78,764.00	0.15
266	002127	南极电商	14,600	77,964.00	0.15
267	688256	寒武纪	1,200	77,640.00	0.15
268	300168	万达信息	8,200	77,408.00	0.15
269	000686	东北证券	11,050	77,239.50	0.15
270	002191	劲嘉股份	7,200	77,184.00	0.15
271	600839	四川长虹	26,729	76,979.52	0.15
272	002019	亿帆医药	5,500	76,890.00	0.15
273	300251	光线传媒	8,100	76,707.00	0.15
274	002221	东华能源	8,200	76,342.00	0.15
275	600718	东软集团	6,600	75,966.00	0.15
276	600827	百联股份	5,715	75,495.15	0.15

277	603858	步长制药	3,800	74,898.00	0.15
278	002985	北摩高科	1,273	74,572.34	0.14
279	000012	南玻A	10,048	74,556.16	0.14
280	002511	中顺洁柔	5,900	73,868.00	0.14
281	002266	浙富控股	15,400	73,766.00	0.14
282	600409	三友化工	9,000	73,710.00	0.14
283	600155	华创阳安	8,647	73,326.56	0.14
284	600782	新钢股份	14,500	73,080.00	0.14
285	600970	中材国际	7,500	72,675.00	0.14
286	000883	湖北能源	14,200	72,562.00	0.14
287	600060	海信视像	5,800	72,500.00	0.14
288	600201	生物股份	7,900	72,364.00	0.14
289	300630	普利制药	2,050	72,057.50	0.14
290	603885	吉祥航空	4,000	71,960.00	0.14
291	002505	鹏都农牧	21,200	71,868.00	0.14
292	600895	张江高科	5,700	70,965.00	0.14
293	000709	河钢股份	31,400	70,964.00	0.14
294	600498	烽火通信	4,900	70,952.00	0.14
295	000987	越秀金控	10,085	70,897.55	0.14
296	601880	辽港股份	41,700	70,890.00	0.14
297	600598	北大荒	4,800	70,848.00	0.14
298	600663	陆家嘴	6,800	70,448.00	0.14
299	002153	石基信息	4,400	69,828.00	0.14
300	002155	湖南黄金	5,748	69,780.72	0.14
301	000930	中粮科技	7,700	69,608.00	0.14
302	600535	天士力	6,600	69,366.00	0.13
303	002595	豪迈科技	3,100	69,254.00	0.13
304	688208	道通科技	2,100	69,132.00	0.13
305	600282	南钢股份	21,900	68,985.00	0.13
306	000690	宝新能源	15,600	68,328.00	0.13
307	300376	易事特	8,400	68,208.00	0.13

308	002670	国盛金控	7,000	67,200.00	0.13
309	002701	奥瑞金	12,900	67,080.00	0.13
310	603225	新凤鸣	5,720	66,008.80	0.13
311	600064	南京高科	6,000	66,000.00	0.13
312	000598	兴蓉环境	12,800	65,408.00	0.13
313	002532	天山铝业	10,000	65,300.00	0.13
314	600500	中化国际	9,800	65,170.00	0.13
315	600808	马钢股份	17,100	64,809.00	0.13
316	002124	天邦食品	9,620	64,646.40	0.13
317	600517	国网英大	12,400	64,356.00	0.12
318	002002	鸿达兴业	17,300	64,183.00	0.12
319	603927	中科软	2,740	63,896.80	0.12
320	600022	山东钢铁	36,060	62,744.40	0.12
321	688188	柏楚电子	280	61,611.20	0.12
322	600021	上海电力	6,000	61,500.00	0.12
323	600259	广晟有色	1,200	60,780.00	0.12
324	600597	光明乳业	4,800	60,624.00	0.12
325	600764	中国海防	2,400	60,576.00	0.12
326	600216	浙江医药	4,400	60,060.00	0.12
327	601179	中国西电	12,700	59,436.00	0.12
328	300463	迈克生物	2,900	59,421.00	0.12
329	600329	中新药业	2,400	58,992.00	0.11
330	603866	桃李面包	3,558	58,884.90	0.11
331	300115	长盈精密	5,700	58,767.00	0.11
332	002390	信邦制药	8,500	58,735.00	0.11
333	600507	方大特钢	8,398	58,702.02	0.11
334	600567	山鹰国际	20,900	57,893.00	0.11
335	000581	威孚高科	3,000	57,750.00	0.11
336	600572	康恩贝	13,000	57,590.00	0.11
337	600728	佳都科技	8,900	57,494.00	0.11
338	601958	金钼股份	6,500	57,460.00	0.11

339	601778	晶科科技	10,600	57,240.00	0.11
340	002705	新宝股份	2,600	57,174.00	0.11
341	002939	长城证券	5,600	56,896.00	0.11
342	002690	美亚光电	2,611	56,606.48	0.11
343	688006	杭可科技	800	56,048.00	0.11
344	002468	申通快递	4,700	56,024.00	0.11
345	002925	盈趣科技	2,600	55,952.00	0.11
346	000937	冀中能源	7,400	55,204.00	0.11
347	601118	海南橡胶	11,500	54,970.00	0.11
347	600582	天地科技	11,500	54,970.00	0.11
349	688321	微芯生物	2,162	54,460.78	0.11
350	002004	华邦健康	9,700	54,126.00	0.10
351	601860	紫金银行	18,800	53,956.00	0.10
352	600811	东方集团	19,000	53,770.00	0.10
353	002048	宁波华翔	3,297	52,817.94	0.10
354	000559	万向钱潮	8,883	52,765.02	0.10
355	002745	木林森	5,400	52,758.00	0.10
356	000089	深圳机场	6,800	52,496.00	0.10
357	600195	中牧股份	4,244	52,031.44	0.10
358	600967	内蒙一机	5,700	51,984.00	0.10
359	600737	中粮糖业	6,900	51,888.00	0.10
360	000898	鞍钢股份	16,100	51,842.00	0.10
361	603883	老百姓	1,530	51,836.40	0.10
362	600037	歌华有线	5,510	51,738.90	0.10
363	601000	唐山港	19,900	51,342.00	0.10
364	688777	中控技术	700	50,932.00	0.10
365	688289	圣湘生物	1,700	50,337.00	0.10
366	002368	太极股份	2,620	50,330.20	0.10
367	601106	中国一重	16,300	50,041.00	0.10
368	002174	游族网络	5,100	49,827.00	0.10
369	601333	广深铁路	22,800	49,704.00	0.10

370	002233	塔牌集团	5,600	49,560.00	0.10
371	000540	中天金融	25,300	48,829.00	0.09
372	000537	广宇发展	3,740	48,582.60	0.09
373	001914	招商积余	2,700	48,519.00	0.09
374	002010	传化智联	7,500	48,225.00	0.09
375	603228	景旺电子	2,047	47,756.51	0.09
376	000402	金融街	8,009	47,653.55	0.09
377	600435	北方导航	5,502	47,427.24	0.09
378	600120	浙江东方	11,728	47,029.28	0.09
379	000488	晨鸣纸业	8,200	46,248.00	0.09
380	600398	海澜之家	9,700	46,075.00	0.09
381	000990	诚志股份	4,200	45,990.00	0.09
382	600959	江苏有线	14,100	45,966.00	0.09
383	600167	联美控股	6,100	45,689.00	0.09
384	002110	三钢闽光	7,500	45,675.00	0.09
385	600446	金证股份	4,400	45,672.00	0.09
386	600707	彩虹股份	9,700	45,396.00	0.09
387	601611	中国核建	5,400	45,306.00	0.09
388	000158	常山北明	7,500	45,000.00	0.09
389	002416	爱施德	4,780	44,454.00	0.09
390	002146	荣盛发展	14,600	44,238.00	0.09
391	002281	光迅科技	2,500	43,950.00	0.09
392	000685	中山公用	5,700	43,776.00	0.08
393	603317	天味食品	1,528	43,502.16	0.08
394	300212	易华录	2,500	43,500.00	0.08
395	603638	艾迪精密	2,120	43,460.00	0.08
396	601098	中南传媒	4,590	43,329.60	0.08
397	002382	蓝帆医疗	4,500	42,975.00	0.08
398	600373	中文传媒	4,294	42,897.06	0.08
399	002429	兆驰股份	11,100	42,624.00	0.08
400	601608	中信重工	11,083	42,004.57	0.08

401	001965	招商公路	5,500	41,965.00	0.08
402	600131	国网信通	3,100	41,695.00	0.08
403	600928	西安银行	11,300	41,471.00	0.08
404	002081	金螳螂	8,100	41,148.00	0.08
405	300072	三聚环保	8,104	41,006.24	0.08
406	300166	东方国信	4,400	40,568.00	0.08
407	601456	国联证券	3,300	40,491.00	0.08
408	000528	柳工	6,200	40,362.00	0.08
409	600376	首开股份	8,200	40,262.00	0.08
410	600126	杭钢股份	7,800	39,936.00	0.08
411	000563	陕国投A	12,700	39,624.00	0.08
412	000656	金科股份	13,700	39,182.00	0.08
413	601200	上海环境	3,851	39,126.16	0.08
414	603650	彤程新材	1,200	39,096.00	0.08
415	600717	天津港	9,726	39,001.26	0.08
416	600006	东风汽车	5,100	38,505.00	0.07
417	601991	大唐发电	15,800	38,394.00	0.07
418	002948	青岛银行	10,550	38,191.00	0.07
419	300257	开山股份	2,500	37,400.00	0.07
420	600906	财达证券	4,130	37,128.70	0.07
421	002434	万里扬	4,300	36,765.00	0.07
422	688029	南微医学	420	36,624.00	0.07
423	002399	海普瑞	2,071	36,408.18	0.07
424	002387	维信诺	5,312	35,696.64	0.07
425	000718	苏宁环球	9,700	35,696.00	0.07
426	601928	凤凰传媒	4,900	35,035.00	0.07
427	000671	阳光城	15,900	34,821.00	0.07
428	600901	江苏租赁	6,700	34,371.00	0.07
429	000415	渤海租赁	15,800	34,286.00	0.07
430	000959	首钢股份	7,200	34,272.00	0.07
431	000553	安道麦A	2,800	33,908.00	0.07

432	601598	中国外运	8,700	33,756.00	0.07
433	002867	周大生	2,150	33,389.50	0.06
434	300888	稳健医疗	500	33,250.00	0.06
435	600307	酒钢宏兴	17,100	33,174.00	0.06
436	000031	大悦城	8,167	32,668.00	0.06
437	600648	外高桥	2,400	32,640.00	0.06
438	601718	际华集团	10,400	32,240.00	0.06
439	600787	中储股份	5,600	31,864.00	0.06
440	688088	虹软科技	1,000	31,590.00	0.06
441	000961	中南建设	10,200	31,110.00	0.06
442	600339	中油工程	10,700	30,923.00	0.06
443	002242	九阳股份	1,679	30,826.44	0.06
444	001227	兰州银行	6,100	30,012.00	0.06
445	600623	华谊集团	3,585	29,755.50	0.06
446	002423	中粮资本	4,400	29,524.00	0.06
447	600968	海油发展	11,400	29,412.00	0.06
448	603000	人民网	2,600	29,120.00	0.06
449	601228	广州港	7,900	28,993.00	0.06
450	600835	上海机电	2,100	28,833.00	0.06
451	600556	天下秀	3,500	28,805.00	0.06
452	600095	湘财股份	3,600	27,684.00	0.05
453	000028	国药一致	901	26,840.79	0.05
454	601665	齐鲁银行	5,300	25,864.00	0.05
455	000062	深圳华强	2,000	25,400.00	0.05
456	600871	石化油服	13,000	24,570.00	0.05
457	000785	居然之家	5,500	24,475.00	0.05
458	688819	天能股份	700	24,206.00	0.05
459	002563	森马服饰	3,900	23,088.00	0.04
460	601139	深圳燃气	3,300	22,902.00	0.04
461	003035	南网能源	3,600	22,860.00	0.04
462	000967	盈峰环境	4,500	22,770.00	0.04

463	300869	康泰医学	800	22,608.00	0.04
464	002653	海思科	1,400	22,554.00	0.04
465	601969	海南矿业	2,600	22,334.00	0.04
466	300741	华宝股份	800	22,256.00	0.04
467	001872	招商港口	1,400	21,840.00	0.04
468	002815	崇达技术	1,700	21,777.00	0.04
469	000156	华数传媒	2,700	21,519.00	0.04
470	603056	德邦股份	1,600	21,488.00	0.04
471	002945	华林证券	1,400	21,350.00	0.04
472	601298	青岛港	3,900	21,333.00	0.04
473	000869	张裕A	700	20,818.00	0.04
474	600377	宁沪高速	2,400	20,568.00	0.04
475	600350	山东高速	3,900	20,475.00	0.04
476	603379	三美股份	920	20,470.00	0.04
477	000717	韶钢松山	5,800	20,300.00	0.04
478	600927	永安期货	1,000	20,170.00	0.04
479	601869	长飞光纤	600	18,552.00	0.04
480	600299	安迪苏	1,900	18,202.00	0.04
481	601828	美凯龙	3,000	18,180.00	0.04
482	601187	厦门银行	2,800	16,688.00	0.03
483	601156	东航物流	800	15,840.00	0.03
484	600823	世茂股份	5,300	15,794.00	0.03
485	603868	飞科电器	200	15,150.00	0.03
486	600917	重庆燃气	2,000	14,440.00	0.03
487	603719	良品铺子	500	14,315.00	0.03
488	603515	欧普照明	800	13,960.00	0.03
489	601003	柳钢股份	3,300	13,365.00	0.03
490	603355	莱克电气	500	12,615.00	0.02
491	601568	北元集团	1,980	12,553.20	0.02
492	001203	大中矿业	1,100	12,430.00	0.02
493	603786	科博达	200	12,314.00	0.02

494	002901	大博医疗	300	11,742.00	0.02
495	600956	新天绿能	900	11,088.00	0.02
496	002946	新乳业	800	10,392.00	0.02
497	603983	丸美股份	300	8,040.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	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
6	001319	铭科精技	281	8,112.47	0.02

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	688122	西部超导	365,523.39	0.84
2	601108	财通证券	348,830.10	0.80
3	300012	华测检测	289,151.00	0.66
4	002497	雅化集团	284,020.00	0.65
5	002240	盛新锂能	276,778.00	0.63
6	600096	云天化	261,314.00	0.60
7	688180	君实生物	238,676.00	0.55
8	300769	德方纳米	238,000.00	0.54
9	000009	中国宝安	237,978.00	0.54
10	601615	明阳智能	235,982.00	0.54
11	300073	当升科技	222,041.00	0.51

12	600522	中天科技	214,537.00	0.49
13	300390	天华超净	213,304.00	0.49
14	002756	永兴材料	202,600.00	0.46
15	002407	多氟多	195,088.00	0.45
16	601058	赛轮轮胎	191,473.00	0.44
17	600256	广汇能源	191,419.00	0.44
18	000783	长江证券	172,639.00	0.39
19	600499	科达制造	170,962.00	0.39
20	600157	永泰能源	169,259.00	0.39

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	000733	振华科技	464,954.00	1.06
2	600188	兖矿能源	343,947.00	0.79
3	002340	格林美	339,706.00	0.78
4	600884	杉杉股份	299,967.50	0.69
5	000723	美锦能源	271,752.00	0.62
6	601117	中国化学	266,028.00	0.61
7	601689	拓普集团	248,250.35	0.57
8	688005	容百科技	189,941.00	0.43
9	300751	迈为股份	174,858.40	0.40
10	600733	北汽蓝谷	172,923.00	0.40
11	002080	中材科技	159,389.00	0.36
12	600157	永泰能源	133,385.00	0.30
13	600522	中天科技	123,390.00	0.28
14	300223	北京君正	120,618.00	0.28
15	300363	博腾股份	117,894.00	0.27
16	300763	锦浪科技	115,948.00	0.27
17	601555	东吴证券	114,355.00	0.26

18	688536	思瑞浦	110,286.00	0.25
19	601975	招商南油	107,800.00	0.25
20	600803	新奥股份	106,377.00	0.24

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	28,530,413.59
卖出股票收入（成交）总额	18,553,248.63

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	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

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	9,970	1,008,189.62	1.96

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：督促公司妥善处置风险事项、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。

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	6,041.25
2	应收清算款	-

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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,844,658.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
13,662	2,402.36	0.00	0.00%	32,821,026.04	100.00%

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	10,126.95	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
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(2018年12月07日)基金份额总额	255,386,460.94
本报告期期初基金份额总额	24,917,975.70
本报告期基金总申购份额	24,824,471.47
减：本报告期基金总赎回份额	16,921,421.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本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。

§ 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	23,981,436.09	51.01%	17,538.26	51.01%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	23,030,274.49	48.99%	16,842.32	48.99%	-
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	999,093.70	100.00%	200,000.00	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202	中国证监会规	2022-01-24

	1年4季度报告提示性公告	定报刊及网站	
5	人保中证500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	人保中证500指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-29
8	人保中证500指数型证券投资基金招募说明书更新(2022年第1号)	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	人保中证500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	人保中证500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	人保中证500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 - 20220113	7,199,000.00	0.00	7,199,000.00	0.00	0.00%
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。

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