

人保中证500指数型证券投资基金

2023年第4季度报告

2023年12月31日

基金管理人:中国人保资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2024年01月19日

目录

§1 重要提示	3
§2 基金产品概况	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	5
4.1 基金经理（或基金经理小组）简介	5
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	6
4.3 公平交易专项说明	6
4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析	7
4.5 报告期内基金的业绩表现	7
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	7
§5 投资组合报告	7
5.1 报告期末基金资产组合情况	7
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	8
5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	10
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	10
5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	11
5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	11
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	11
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	11
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	11
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	11
5.11 投资组合报告附注	11
§6 开放式基金份额变动	12
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	13
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况	13
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细	13
§8 影响投资者决策的其他重要信息	13
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	13
8.2 影响投资者决策的其他重要信息	13
§9 备查文件目录	13
9.1 备查文件目录	13
9.2 存放地点	13
9.3 查阅方式	14

§1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年1月18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2023年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	人保中证500
基金主代码	006611
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月07日
报告期末基金份额总额	25,558,786.18份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证500指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
投资策略	本基金原则上采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金主要按照标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以达到复制和跟踪标的指数的目的。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其

	预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金。
基金管理人	中国人保资产管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023年10月01日 - 2023年12月31日）
1.本期已实现收益	-561,915.78
2.本期利润	-1,741,420.97
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0680
4.期末基金资产净值	35,080,186.74
5.期末基金份额净值	1.3725

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.73%	0.81%	-4.36%	0.82%	-0.37%	-0.01%
过去六个月	-8.60%	0.79%	-9.01%	0.81%	0.41%	-0.02%
过去一年	-5.39%	0.77%	-7.01%	0.78%	1.62%	-0.01%
过去三年	-9.33%	1.01%	-13.83%	1.03%	4.50%	-0.02%
过去五年	43.64%	1.20%	29.29%	1.22%	14.35%	-0.02%
自基金合同生效起至今	37.25%	1.19%	22.52%	1.22%	14.73%	-0.03%

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



- 注：1、本基金基金合同于2018年12月7日生效。根据基金合同规定，本基金建仓期为6个月，建仓期结束，本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。
- 2、本基金业绩比较基准为：中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石晓冉	基金经理	2020-08-03	2023-10-13	6.5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日起至2023年10月13日任人保沪深300指数型证券投资基金、人

					保中证500指数型证券投资基金基金经理，2020年8月3日至2022年9月19日任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日至2023年7月19日任人保优势产业混合型证券投资基金基金经理，2022年9月19日至2023年10月13日任人保研究精选混合型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金基金经理。
周剑	基金经理	2023-07-13	-	7年	华东理工大学金融学硕士，曾在中欧基金管理有限公司担任量化分析师、研究助理、研究员。2023年1月加入人保资产公募基金事业部，自2023年7月13日起任人保中证500指数型证券投资基金基金经理、2023年9月15日起担任人保沪深300指数型证券投资基金基金经理。

注：1、基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

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

本基金作为一只跟踪中证500指数的被动指数产品，基金管理人将运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保中证500基金份额净值为1.3725元，本报告期内，基金份额净值增长率为-4.73%，同期业绩比较基准收益率为-4.36%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金自2023年10月9日至2023年12月29日连续60个工作日净值低于5000万，公司正在完善相关方案。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的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	32,890,653.77	92.85
	其中：股票	32,890,653.77	92.85
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	1,812,019.26	5.12
	其中：债券	1,812,019.26	5.12
	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	200,000.00	0.56
	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	462,173.93	1.30
8	其他资产	58,686.26	0.17
9	合计	35,423,533.22	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	226,153.00	0.64
B	采矿业	1,278,159.19	3.64
C	制造业	20,723,634.97	59.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,074,233.66	3.06
E	建筑业	263,608.00	0.75
F	批发和零售业	992,040.83	2.83
G	交通运输、仓储和邮政业	613,127.00	1.75
H	住宿和餐饮业	53,420.40	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,489,460.26	7.10
J	金融业	2,987,222.18	8.52
K	房地产业	410,885.86	1.17
L	租赁和商务服务业	294,402.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	301,691.20	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	175,154.00	0.50
O	居民服务、修理和其他服	-	-

	务业		
P	教育	90,576.00	0.26
Q	卫生和社会工作	252,522.00	0.72
R	文化、体育和娱乐业	470,576.22	1.34
S	综合	193,787.00	0.55
	合计	32,890,653.77	93.76

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	3,700	182,484.00	0.52
2	002422	科伦药业	6,100	177,205.00	0.51
3	002028	思源电气	3,200	166,528.00	0.47
4	601058	赛轮轮胎	13,800	162,150.00	0.46
5	300418	昆仑万维	4,300	160,820.00	0.46
6	600418	江淮汽车	9,700	156,655.00	0.45
7	600157	永泰能源	113,600	155,632.00	0.44
8	000988	华工科技	5,200	154,752.00	0.44
9	002463	沪电股份	6,900	152,628.00	0.44
10	601555	东吴证券	20,660	151,024.60	0.43

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000540	*ST中天	27,500	0.00	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,809,419.18	5.16
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）	2,600.08	0.01

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,812,019.26	5.17

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019709	23国债16	18,000	1,809,419.18	5.16
2	127102	浙建转债	26	2,600.08	0.01

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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 思源电气（代码：002028.SZ）为本基金前十大持仓证券。2023年11月10日，据中华人民共和国洋山港海事局发布的行政处罚信息显示，思源电气股份有限公司因托运人未将托运的危险货物的正式名称、危险性质以及应当采取的防护措施通知承运人，中华人民共和国洋山港海事局对其处以罚款人民币6万元。

昆仑万维（昆仑万维300418）为本基金前十大持仓证券。2023年3月26日，昆仑万维科技股份有限公司收到深圳证券交易所出具的《关于对昆仑万维科技股份有限公司的监管函》（创业板监管函〔2023〕第38号），其中提及昆仑万维科技股份有限公司在ChatGPT及相关概念受投资者广泛关注的背景下，通过互动易回复投资者咨询时未能客观、完整地介绍和反映公司相关业务的实际情况、对公司业绩的影响及充分提示相关风险。上述行为违反了深圳证券交易所《创业板股票上市规则（2023年修订）》第1.4条，第5.1.1条及《上市公司自律监管指引第2号--创业板上市公司规范运作》第8.1.1条的规定，

深圳证券交易所要求昆仑万维科技股份有限公司董事会充分重视,吸取教训,及时整改,杜绝前述问题再次发生。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,191.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	35,494.45
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	58,686.26

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	000540	*ST中天	0.00	0.00	摘牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	25,754,665.29
报告期期间基金总申购份额	1,527,518.43
减：报告期期间基金总赎回份额	1,723,397.54
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	25,558,786.18

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

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区西长安街88号中国人保大厦

基金托管人地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

2024年01月19日