

人保中证 500 指数型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 31 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2024年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024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 | 7 |
| 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 | 11 |
| 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 | 12 |
| 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 | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| §7 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 58 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 60 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 60 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 61 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 61 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 61 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 61 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 61 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 61 |
| §8 基金份额持有人信息 | 62 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 62 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 63 |

| | |
|--|----|
| 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 | 63 |
| §9 开放式基金份额变动 | 63 |
| §10 重大事件揭示 | 63 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 63 |
| 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 | 64 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 64 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 64 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 64 |
| 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 | 64 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 64 |
| 10.8 其他重大事件 | 66 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 67 |
| 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 | 67 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 68 |
| §12 备查文件目录 | 68 |
| 12.1 备查文件目录 | 68 |
| 12.2 存放地点 | 68 |
| 12.3 查阅方式 | 68 |

§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 | 53,869,837.70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 | 郭乐琦 | 方圆 |
| | 联系电话 | 021-38572076 | 95559 |
| | 电子邮箱 | guolq@piccamc.com | fangy_20@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-820-7999 | 95559 |
| 传真 | | 021-50765598 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号 |
| 办公地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元 | 中国（上海）长宁区仙霞路18号 |
| 邮政编码 | | 100031 | 200336 |
| 法定代表人 | | 黄本尧 | 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 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号20层、21层、22层、25层03、04单元、26层01、02、07、08单元 |

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日) |
|---------------|----------------------------------|
| 本期已实现收益 | -254,977.65 |
| 本期利润 | -5,573,381.69 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1755 |
| 本期加权平均净值利润率 | -13.22% |
| 本期基金份额净值增长率 | -7.64% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2024年06月30日) |
| 期末可供分配利润 | 14,418,406.52 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2677 |
| 期末基金资产净值 | 68,288,244.22 |
| 期末基金份额净值 | 1.2677 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2024年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 26.77% |

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 | -5.80% | 0.90% | -6.55% | 0.91% | 0.75% | -0.01% |
| 过去三个月 | -5.10% | 1.07% | -6.16% | 1.09% | 1.06% | -0.02% |
| 过去六个月 | -7.64% | 1.51% | -8.46% | 1.53% | 0.82% | -0.02% |
| 过去一年 | -15.58% | 1.19% | -16.71% | 1.21% | 1.13% | -0.02% |
| 过去三年 | -22.13% | 1.11% | -26.01% | 1.14% | 3.88% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 26.77% | 1.22% | 12.15% | 1.25% | 14.62% | -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-2024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（以下简称人保资产）成立于2003年7月16日，是经国务院同意、原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1.7万亿元人民币，

具备原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，具有国家外汇管理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。

成立二十年来，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。

二十年来，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、资产管理产品等业务，积极开展公募基金业务，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；二十年来，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。

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2024年6月30日，本公司旗下基金产品线逐渐丰富，涵盖了股票指数型、债券型、混合型、货币型产品，管理的基金产品分别为人保货币市场基金、人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金、人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金、人保利丰纯债债券型证券投资基金、人保安睿一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保安和一年定期开放债券型发起式证券投资基金、人保民富债券型证券投资基金、人保中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、人保民享利率债债券型证券投资基金、人保泰睿积极配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）等。

心有所向，路必不远。面向未来，人保资产将深刻理解和把握服务中国式现代化的“人保坐标”，深入贯彻落实人保集团卓越战略，踔厉奋发，奋力开创人保资产高质量发展的新局面，谱写新时代卓越保险资产管理公司的新篇章！

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 周剑 | 基金经理 | 2023-07-13 | - | 7.5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) 指数成份股的调整；4) 指数成份股的停牌。

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1.2677元，本报告期内，基金份额净值增长率为-7.64%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年上半年，我国经济实现5%的增长，为完成全年5%左右的经济增长目标奠定了基础。或许国内经济面临的真正挑战来自明年，且短期人民币汇率受中美利差扩大而承压，因此上半年来，国内财政、货币两端均保持相对克制。

上半年，我们看到一些国内经济较为积极的部分，如出口表现较为亮眼，一线城市地产限制政策在四月政治局会议后得到快速松绑等；但也不能忽视经济的内在隐忧，如通胀疲弱，实体信贷需求差，房地产数据滑坡等。

6月加拿大央行、欧央行、瑞士央行等先后落地降息操作，海外流行性转好的预期逐步兑现，海外经济体证券市场普涨。相较于海外，A股上半年表现不尽如人意，上证指数几度失守3000点，小盘股受资金去杠杆、打击量化、规范退市等影响回调幅度较大，红利板块则在低风险偏好资金推动下表现出色。

站在当前点位，我们看到影响A股市场的风险已得到一定释放，估值回落带来股市投资性价比逐步提升。伴随美国通胀回落与就业市场压力回升，市场不断修正对美联储的降息预期，从目前来看，美国最早或于Q3迎来首次降息，届时人民币汇率承压局面或将有所改观，国内货币政策空间或也将得以打开。

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。

4.6 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改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值委员会，成员主要由公募基金事业部相关领导、投研、交易、合规风控及运营等部门人员组成，以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理列席会议，但不参与具体决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，因赎回等原因，本基金自2024年1月2日至2024年5月17日连续88个工作日净值低于5000万。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，中国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运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由中国人保资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关人保中证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：2024年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024年06月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 564,053.68 | 446,119.90 |
| 结算备付金 | | 308,919.81 | 16,054.03 |
| 存出保证金 | | 9,059.62 | 23,191.81 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 67,161,019.02 | 34,702,673.03 |
| 其中：股票投资 | | 63,716,880.41 | 32,890,653.77 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 3,444,138.61 | 1,812,019.26 |
| 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 | 400,000.00 | 200,000.00 |
| 应收清算款 | | 87.12 | - |
| 应收股利 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 应收申购款 | | 20,603.28 | 35,494.45 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 68,463,742.53 | 35,423,533.22 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年06月30日 | 上年度末 2023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 | | - | 200,000.00 |
| 应付赎回款 | | 24,557.29 | 59,036.03 |
| 应付管理人报酬 | | 26,178.65 | 13,439.17 |
| 应付托管费 | | 5,817.48 | 2,986.48 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 32.45 | 10.09 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 118,912.44 | 67,874.71 |
| 负债合计 | | 175,498.31 | 343,346.48 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 53,869,837.70 | 25,558,786.18 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 14,418,406.52 | 9,521,400.56 |
| 净资产合计 | | 68,288,244.22 | 35,080,186.74 |
| 负债和净资产总计 | | 68,463,742.53 | 35,423,533.22 |

注：报告截止日2023年12月31日，人保中证500份额净值人民币1.3725元，基金份额总额25,558,786.18份。

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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024年01月01日至 2024年06月30日 | 上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日 |
|---------------------------|----------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | -5,328,556.08 | 2,723,774.46 |
| 1.利息收入 | | 4,370.63 | 14,036.49 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 2,551.59 | 14,036.49 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息 收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产 收入 | | 1,819.04 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-” 填列） | | -16,256.73 | 656,005.45 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -820,983.95 | 257,762.16 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 16,613.04 | -1,405.36 |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 788,114.18 | 399,648.65 |
| 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 | -5,318,404.04 | 1,998,932.01 |
| 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 | 1,734.06 | 54,800.51 |

| | | | |
|---------------------|------------|---------------|--------------|
| 减：二、营业总支出 | | 244,825.61 | 258,156.95 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 93,449.25 | 103,927.83 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 20,766.47 | 23,095.07 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | | 168.09 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 168.09 | - |
| 6.信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7.税金及附加 | | 6.54 | - |
| 8.其他费用 | 6.4.7.19 | 130,435.26 | 131,134.05 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -5,573,381.69 | 2,465,617.51 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -5,573,381.69 | 2,465,617.51 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -5,573,381.69 | 2,465,617.51 |

6.3 净资产变动表

会计主体：人保中证500指数型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年01月01日至2024年06月30日 | | |
|-----------|-------------------------------|--------------|---------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 25,558,786.18 | 9,521,400.56 | 35,080,186.74 |
| 二、本期期初净资产 | 25,558,786.18 | 9,521,400.56 | 35,080,186.74 |
| 三、本期增减变动 | 28,311,051.52 | 4,897,005.96 | 33,208,057.48 |

| | | | |
|--|------------------------------------|---------------|---------------|
| 额（减少以“-”号填列） | | | |
| （一）、综合收益总额 | - | -5,573,381.69 | -5,573,381.69 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | 28,311,051.52 | 10,470,387.65 | 38,781,439.17 |
| 其中：1.基金申购款 | 31,782,227.44 | 11,557,733.63 | 43,339,961.07 |
| 2.基金赎回款 | -3,471,175.92 | -1,087,345.98 | -4,558,521.90 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 53,869,837.70 | 14,418,406.52 | 68,288,244.22 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 29,433,072.77 | 13,265,730.28 | 42,698,803.05 |
| 二、本期期初净资产 | 29,433,072.77 | 13,265,730.28 | 42,698,803.05 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -3,256,627.53 | -135,935.93 | -3,392,563.46 |
| （一）、综合收益总额 | - | 2,465,617.51 | 2,465,617.51 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净 | -3,256,627.53 | -2,601,553.44 | -5,858,180.97 |

| | | | |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 28,377,466.06 | 14,502,291.34 | 42,879,757.40 |
| 2.基金赎回款 | -31,634,093.59 | -17,103,844.78 | -48,737,938.37 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 26,176,445.24 | 13,129,794.35 | 39,306,239.59 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄明

贾鸣

沈静

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

人保中证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号的验资报告。基金合同于2018年12月7日正式生效。本基金的管理人为中国人保资产管理有限公司，托管人为交通银行股份有限公司。

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，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）。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、存托凭证）、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。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：中证500指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率（税后） \times 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》、应用指南、解释及其他相关规定，并参照中国证监会发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》等基金行业实务操作的有关规定编制。

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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

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 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | |
|--------------|-------------|--|
| | 2024年06月30日 | |
| 活期存款 | 564,053.68 | |
| 等于：本金 | 564,005.88 | |
| 加：应计利息 | 47.80 | |
| 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 | 564,053.68 | |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | | |
|---------------|---------------|--------------|---------------|---------------|----------|
| | 2024年06月30日 | | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 71,974,452.91 | - | 63,716,880.41 | -8,257,572.50 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 3,407,425.48 | 29,918.61 | 3,444,138.61 | 6,794.52 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 3,407,425.48 | 29,918.61 | 3,444,138.61 | 6,794.52 |

| | | | | |
|--------|---------------|-----------|---------------|---------------|
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 75,381,878.39 | 29,918.61 | 67,161,019.02 | -8,250,777.98 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年06月30日 | |
|-------|--------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 400,000.00 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 400,000.00 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无因买断式逆回购交易而取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 2.13 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 39,075.05 |

| | |
|----------|------------|
| 其中：交易所市场 | 39,075.05 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 29,835.26 |
| 其他应付 | 50,000.00 |
| 合计 | 118,912.44 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年01月01日至2024年06月30日 | |
|---------------|-------------------------------|---------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 25,558,786.18 | 25,558,786.18 |
| 本期申购 | 31,782,227.44 | 31,782,227.44 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,471,175.92 | -3,471,175.92 |
| 本期末 | 53,869,837.70 | 53,869,837.70 |

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

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 |
|----------------|---------------|----------------|---------------|
| 上年度末 | 27,674,290.20 | -18,152,889.64 | 9,521,400.56 |
| 本期期初 | 27,674,290.20 | -18,152,889.64 | 9,521,400.56 |
| 本期利润 | -254,977.65 | -5,318,404.04 | -5,573,381.69 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 30,424,388.57 | -19,954,000.92 | 10,470,387.65 |
| 其中：基金申购款 | 34,165,136.32 | -22,607,402.69 | 11,557,733.63 |
| 基金赎回款 | -3,740,747.75 | 2,653,401.77 | -1,087,345.98 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 57,843,701.12 | -43,425,294.60 | 14,418,406.52 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年01月01日至2024年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 2,049.48 |
| 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 | 407.08 |
| 其他 | 95.03 |
| 合计 | 2,551.59 |

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 8,241,410.99 |
| 减：卖出股票成本总额 | 9,015,015.99 |
| 减：交易费用 | 47,378.95 |
| 买卖股票差价收入 | -820,983.95 |

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 2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 15,158.78 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,454.26 |
| 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 | 16,613.04 |

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 2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 406,509.94 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 400,959.52 |
| 减：应计利息总额 | 4,096.05 |
| 减：交易费用 | 0.11 |
| 买卖债券差价收入 | 1,454.26 |

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 2024年01月01日至2024年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 788,114.18 |
| 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 | 788,114.18 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|-------------------------|
| | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 1.交易性金融资产 | -5,318,404.04 |
| ——股票投资 | -5,321,203.56 |
| ——债券投资 | 2,799.52 |
| ——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 | -5,318,404.04 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|-------------------------|
| | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 1,730.27 |
| 转换费收入 | 3.79 |
| 合计 | 1,734.06 |

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 |
|------|-------------------------|
| | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 审计费用 | 4,972.24 |

| | |
|------------|------------|
| 信息披露费 | 24,863.02 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 600.00 |
| 其他费用_指数使用费 | 100,000.00 |
| 合计 | 130,435.26 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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 2024年01月01日至20 24年06月30日 | 上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 93,449.25 | 103,927.83 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 34,117.95 | 38,366.84 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 59,331.30 | 65,560.99 |

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年01月01日至2024 年06月30日 | 上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 20,766.47 | 23,095.07 |

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

6.4.10.2.3 销售服务费

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自有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2024年06月30日 | | 上年度末 2023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 |
| 中国人民健康保险股份有限公司 | 22,024,800.75 | 40.89% | 0.00 | 0.00% |

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 2024年01月01日至2024年06月30日 | | 上年度可比期间 2023年01月01日至2023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 | 564,053.68 | 2,049.48 | 3,055,112.29 | 13,437.85 |

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（2024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：债券 | | | | | | | | | | |
|----------------------|-------|------------|--------|--------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 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：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 113685 | N升24转 | 2024-06-14 | 18个交易日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.01 | 130 | 13,000.00 | 13,000.97 | - |

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 |
|--------|-------|------------|------|--------|------|--------|-----------|-----------|--------|----|
| 000540 | *ST中天 | 2023-05-19 | 已退市 | - | - | - | 27,500 | 55,512.90 | - | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在力求基金资产安全性、较高流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本基金的基金管理人建立了由董事会负最终责任、管理层直接领导、内部控制职能部门统筹协调、内部控制评价部门监察监督、业务职能部门负首要责任的分工明确、路线清晰、相互协作、有效执行的内部控制组织体系。公募基金事业部部务会为公募基金业务日常运行管理的议事机构，负责事业部经营管理重要事项的研究与决定，以及拟提交公司审批事项的审核。

为加强公募基金管理的内部控制，防范和化解经营风险，提高经营管理效益，保障基金持有人利益，基金管理人遵照中国法律和公司章程的规定履行职责，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；公募基金事业部及各职能部门根据既定的

业务规范、制度执行具体业务；董事会下设风险管理与消费者权益保护委员会、监事会、总裁室下设风险合规委员会、风险管理部、法律合规部为公司不同层面的监督机构，构成公司相对独立的监督系统。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024年06月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | - | - |

| | | |
|-------|-----------|----------|
| AAA以下 | 13,000.97 | 2,600.08 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 13,000.97 | 2,600.08 |

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 2024年0 6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 564,053.68 | - | - | - | 564,053.68 |
| 结算备付金 | 308,919.81 | - | - | - | 308,919.81 |
| 存出保证金 | 9,059.62 | - | - | - | 9,059.62 |
| 交易性金融资产 | 3,444,138.61 | - | - | 63,716,880.41 | 67,161,019.02 |
| 买入返售金融资产 | 400,000.00 | - | - | - | 400,000.00 |
| 应收清算款 | - | - | - | 87.12 | 87.12 |
| 应收申购款 | - | - | - | 20,603.28 | 20,603.28 |
| 资产总计 | 4,726,171.72 | - | - | 63,737,570.81 | 68,463,742.53 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 24,557.29 | 24,557.29 |
| 应付管理人报 | - | - | - | 26,178.65 | 26,178.65 |

| | | | | | |
|-----------------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 酬 | | | | | |
| 应付托 管费 | - | - | - | 5,817.48 | 5,817.48 |
| 应交税 费 | - | - | - | 32.45 | 32.45 |
| 其他负 债 | - | - | - | 118,912.44 | 118,912.44 |
| 负债总 计 | - | - | - | 175,498.31 | 175,498.31 |
| 利率敏 感度缺 口 | 4,726,171.72 | - | - | 63,562,072.50 | 68,288,244.22 |
| 上年度 末 2023年1 2月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资 金 | 446,119.90 | - | - | - | 446,119.90 |
| 结算备 付金 | 16,054.03 | - | - | - | 16,054.03 |
| 存出保 证金 | 23,191.81 | - | - | - | 23,191.81 |
| 交易性 金融资 产 | 1,812,019.26 | - | - | 32,890,653.77 | 34,702,673.03 |
| 买入返 售金融 资产 | 200,000.00 | - | - | - | 200,000.00 |
| 应收申 购款 | - | - | - | 35,494.45 | 35,494.45 |
| 资产总 计 | 2,497,385.00 | - | - | 32,926,148.22 | 35,423,533.22 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清 算款 | - | - | - | 200,000.00 | 200,000.00 |

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 应付赎回款 | - | - | - | 59,036.03 | 59,036.03 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 13,439.17 | 13,439.17 |
| 应付托管费 | - | - | - | 2,986.48 | 2,986.48 |
| 应交税费 | - | - | - | 10.09 | 10.09 |
| 其他负债 | - | - | - | 67,874.71 | 67,874.71 |
| 负债总计 | - | - | - | 343,346.48 | 343,346.48 |
| 利率敏感度缺口 | 2,497,385.00 | - | - | 32,582,801.74 | 35,080,186.74 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--------------------------------|---------------------------------|---------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
| 假设 | 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线) | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元) | |
| | | 本期末 2024年06月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
| | 1. 市场利率上升25个基点 | -4,142.62 | -2,575.11 |
| | 2. 市场利率下降25个基点 | 4,163.04 | 2,585.56 |

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 2024年06月30日 | | 上年度末 2023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 | 63,716,880.41 | 93.31 | 32,890,653.77 | 93.76 |
| 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 | 63,716,880.41 | 93.31 | 32,890,653.77 | 93.76 |

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 2024年06月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
| | 1. 业绩比较基准增加5% | 3,158,726.05 | 1,666,764.99 |
| | 2. 业绩比较基准减少5% | -3,158,726.05 | -1,666,764.99 |

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公开报价。

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

单位:人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024年06月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次 | 63,716,880.41 | 32,890,653.77 |
| 第二层次 | 3,444,138.61 | 1,812,019.26 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 67,161,019.02 | 34,702,673.03 |

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2024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、结算备付金和其他金融负债，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 | 63,716,880.41 | 93.07 |
| | 其中：股票 | 63,716,880.41 | 93.07 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,444,138.61 | 5.03 |
| | 其中：债券 | 3,444,138.61 | 5.03 |
| | 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 | 400,000.00 | 0.58 |
| | 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 | 872,973.49 | 1.28 |
| 8 | 其他各项资产 | 29,750.02 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 68,463,742.53 | 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 | 398,843.00 | 0.58 |
| B | 采矿业 | 2,975,559.06 | 4.36 |
| C | 制造业 | 40,327,143.17 | 59.05 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,560,949.29 | 3.75 |
| E | 建筑业 | 647,289.00 | 0.95 |
| F | 批发和零售业 | 1,348,963.46 | 1.98 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,280,642.00 | 1.88 |
| H | 住宿和餐饮业 | 201,769.00 | 0.30 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,527,841.24 | 6.63 |
| J | 金融业 | 5,907,552.17 | 8.65 |
| K | 房地产业 | 719,686.78 | 1.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | 486,025.00 | 0.71 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 508,593.40 | 0.74 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 289,472.08 | 0.42 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 70,839.00 | 0.10 |
| Q | 卫生和社会工作 | 394,242.00 | 0.58 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 957,422.76 | 1.40 |
| S | 综合 | 114,048.00 | 0.17 |
| | 合计 | 63,716,880.41 | 93.31 |

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 | - | - |
| 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 | - | - |

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|------------|--------------|
| 1 | 300502 | 新易盛 | 7,600 | 802,180.00 | 1.17 |
| 2 | 601077 | 渝农商行 | 100,900 | 506,518.00 | 0.74 |
| 3 | 002028 | 思源电气 | 6,600 | 441,540.00 | 0.65 |
| 4 | 688169 | 石头科技 | 1,020 | 400,452.00 | 0.59 |
| 5 | 601058 | 赛轮轮胎 | 28,200 | 394,800.00 | 0.58 |
| 6 | 600066 | 宇通客车 | 14,200 | 366,360.00 | 0.54 |
| 7 | 002340 | 格林美 | 55,100 | 350,987.00 | 0.51 |
| 8 | 000933 | 神火股份 | 16,900 | 341,887.00 | 0.50 |
| 9 | 000988 | 华工科技 | 10,800 | 323,244.00 | 0.47 |
| 10 | 601168 | 西部矿业 | 17,900 | 321,305.00 | 0.47 |
| 11 | 300394 | 天孚通信 | 3,600 | 318,312.00 | 0.47 |
| 12 | 002384 | 东山精密 | 14,700 | 304,290.00 | 0.45 |
| 13 | 000423 | 东阿阿胶 | 4,800 | 300,480.00 | 0.44 |
| 14 | 000630 | 铜陵有色 | 82,300 | 297,103.00 | 0.44 |
| 15 | 600418 | 江淮汽车 | 18,700 | 296,208.00 | 0.43 |
| 16 | 600988 | 赤峰黄金 | 17,800 | 290,852.00 | 0.43 |
| 17 | 601233 | 桐昆股份 | 18,100 | 288,876.00 | 0.42 |
| 18 | 600157 | 永泰能源 | 238,200 | 281,076.00 | 0.41 |
| 19 | 002625 | 光启技术 | 16,200 | 281,070.00 | 0.41 |
| 20 | 688617 | 惠泰医疗 | 600 | 273,660.00 | 0.40 |
| 21 | 600096 | 云天化 | 13,800 | 267,996.00 | 0.39 |
| 22 | 601567 | 三星医疗 | 7,600 | 266,000.00 | 0.39 |
| 23 | 000400 | 许继电气 | 7,600 | 261,516.00 | 0.38 |
| 24 | 603529 | 爱玛科技 | 9,400 | 256,902.00 | 0.38 |
| 25 | 688777 | 中控技术 | 6,800 | 256,360.00 | 0.38 |
| 26 | 002156 | 通富微电 | 11,400 | 255,246.00 | 0.37 |
| 27 | 002273 | 水晶光电 | 14,898 | 252,968.04 | 0.37 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 28 | 002128 | 电投能源 | 11,980 | 252,778.00 | 0.37 |
| 29 | 601555 | 东吴证券 | 42,660 | 251,694.00 | 0.37 |
| 30 | 002078 | 太阳纸业 | 18,000 | 251,100.00 | 0.37 |
| 31 | 600885 | 宏发股份 | 8,920 | 246,905.60 | 0.36 |
| 32 | 300207 | 欣旺达 | 16,000 | 242,720.00 | 0.36 |
| 33 | 002223 | 鱼跃医疗 | 6,450 | 242,520.00 | 0.36 |
| 34 | 002532 | 天山铝业 | 29,900 | 242,489.00 | 0.36 |
| 35 | 600352 | 浙江龙盛 | 27,900 | 239,661.00 | 0.35 |
| 36 | 600398 | 海澜之家 | 25,700 | 237,468.00 | 0.35 |
| 37 | 002138 | 顺络电子 | 8,600 | 236,156.00 | 0.35 |
| 38 | 002966 | 苏州银行 | 31,410 | 235,575.00 | 0.34 |
| 39 | 002353 | 杰瑞股份 | 6,600 | 231,528.00 | 0.34 |
| 40 | 601108 | 财通证券 | 34,900 | 230,689.00 | 0.34 |
| 41 | 600765 | 中航重机 | 11,080 | 226,032.00 | 0.33 |
| 42 | 002185 | 华天科技 | 27,500 | 224,125.00 | 0.33 |
| 43 | 002517 | 恺英网络 | 23,100 | 220,605.00 | 0.32 |
| 44 | 600879 | 航天电子 | 28,300 | 219,891.00 | 0.32 |
| 45 | 301236 | 软通动力 | 6,100 | 214,781.00 | 0.31 |
| 46 | 603606 | 东方电缆 | 4,400 | 214,764.00 | 0.31 |
| 47 | 600873 | 梅花生物 | 21,400 | 214,428.00 | 0.31 |
| 48 | 688099 | 晶晨股份 | 3,600 | 213,552.00 | 0.31 |
| 49 | 600177 | 雅戈尔 | 29,800 | 212,176.00 | 0.31 |
| 50 | 601577 | 长沙银行 | 25,900 | 211,862.00 | 0.31 |
| 51 | 600079 | 人福医药 | 12,300 | 211,191.00 | 0.31 |
| 52 | 002738 | 中矿资源 | 7,860 | 210,648.00 | 0.31 |
| 53 | 600109 | 国金证券 | 27,900 | 210,645.00 | 0.31 |
| 54 | 300003 | 乐普医疗 | 14,100 | 209,244.00 | 0.31 |
| 55 | 600060 | 海信视像 | 8,400 | 207,816.00 | 0.30 |
| 56 | 300017 | 网宿科技 | 26,200 | 206,980.00 | 0.30 |
| 57 | 600497 | 驰宏锌锗 | 38,200 | 203,988.00 | 0.30 |
| 58 | 300136 | 信维通信 | 10,400 | 203,632.00 | 0.30 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 59 | 603979 | 金诚信 | 4,000 | 202,120.00 | 0.30 |
| 60 | 603160 | 汇顶科技 | 2,900 | 199,375.00 | 0.29 |
| 61 | 002202 | 金风科技 | 29,600 | 198,912.00 | 0.29 |
| 62 | 002739 | 万达电影 | 16,400 | 198,276.00 | 0.29 |
| 63 | 000932 | 华菱钢铁 | 44,480 | 197,046.40 | 0.29 |
| 64 | 002409 | 雅克科技 | 3,100 | 195,021.00 | 0.29 |
| 65 | 002958 | 青农商行 | 72,400 | 194,032.00 | 0.28 |
| 66 | 000683 | 远兴能源 | 28,000 | 193,480.00 | 0.28 |
| 67 | 600985 | 淮北矿业 | 11,549 | 193,330.26 | 0.28 |
| 68 | 600536 | 中国软件 | 6,461 | 193,313.12 | 0.28 |
| 69 | 600348 | 华阳股份 | 19,350 | 192,726.00 | 0.28 |
| 70 | 002465 | 海格通信 | 18,600 | 192,696.00 | 0.28 |
| 71 | 002281 | 光迅科技 | 5,100 | 190,587.00 | 0.28 |
| 72 | 002444 | 巨星科技 | 7,700 | 190,190.00 | 0.28 |
| 73 | 000009 | 中国宝安 | 22,100 | 190,060.00 | 0.28 |
| 74 | 688120 | 华海清科 | 1,000 | 189,580.00 | 0.28 |
| 75 | 002008 | 大族激光 | 9,000 | 187,200.00 | 0.27 |
| 76 | 000878 | 云南铜业 | 15,009 | 187,012.14 | 0.27 |
| 77 | 002436 | 兴森科技 | 18,100 | 186,792.00 | 0.27 |
| 78 | 300474 | 景嘉微 | 2,950 | 186,528.50 | 0.27 |
| 79 | 600642 | 申能股份 | 21,023 | 185,633.09 | 0.27 |
| 80 | 601615 | 明阳智能 | 19,500 | 184,080.00 | 0.27 |
| 81 | 688122 | 西部超导 | 4,800 | 183,936.00 | 0.27 |
| 82 | 002797 | 第一创业 | 36,000 | 183,240.00 | 0.27 |
| 83 | 000039 | 中集集团 | 19,720 | 182,607.20 | 0.27 |
| 84 | 601990 | 南京证券 | 23,700 | 182,016.00 | 0.27 |
| 85 | 000066 | 中国长城 | 20,800 | 182,000.00 | 0.27 |
| 86 | 600298 | 安琪酵母 | 6,500 | 181,545.00 | 0.27 |
| 87 | 300054 | 鼎龙股份 | 8,000 | 181,440.00 | 0.27 |
| 88 | 300012 | 华测检测 | 18,000 | 181,080.00 | 0.27 |
| 89 | 600529 | 山东药玻 | 7,100 | 179,914.00 | 0.26 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 90 | 688525 | 佰维存储 | 2,800 | 179,620.00 | 0.26 |
| 91 | 002673 | 西部证券 | 28,800 | 178,272.00 | 0.26 |
| 92 | 601666 | 平煤股份 | 15,900 | 178,080.00 | 0.26 |
| 93 | 600839 | 四川长虹 | 39,629 | 177,934.21 | 0.26 |
| 94 | 603596 | 伯特利 | 4,560 | 177,384.00 | 0.26 |
| 95 | 601179 | 中国西电 | 22,000 | 176,880.00 | 0.26 |
| 96 | 000831 | 中国稀土 | 6,800 | 172,380.00 | 0.25 |
| 97 | 300395 | 菲利华 | 5,600 | 172,200.00 | 0.25 |
| 98 | 000783 | 长江证券 | 35,600 | 171,948.00 | 0.25 |
| 99 | 601717 | 郑煤机 | 11,600 | 171,680.00 | 0.25 |
| 100 | 603816 | 顾家家居 | 5,300 | 171,137.00 | 0.25 |
| 101 | 000738 | 航发控制 | 8,500 | 170,595.00 | 0.25 |
| 102 | 300002 | 神州泰岳 | 21,000 | 170,520.00 | 0.25 |
| 103 | 000728 | 国元证券 | 28,100 | 170,286.00 | 0.25 |
| 104 | 002432 | 九安医疗 | 4,200 | 170,268.00 | 0.25 |
| 105 | 600862 | 中航高科 | 9,000 | 169,020.00 | 0.25 |
| 106 | 688180 | 君实生物 | 5,800 | 168,490.00 | 0.25 |
| 107 | 000703 | 恒逸石化 | 23,600 | 167,324.00 | 0.25 |
| 108 | 601198 | 东兴证券 | 20,800 | 165,568.00 | 0.24 |
| 109 | 601997 | 贵阳银行 | 31,400 | 165,478.00 | 0.24 |
| 110 | 000960 | 锡业股份 | 10,600 | 164,194.00 | 0.24 |
| 111 | 002595 | 豪迈科技 | 4,300 | 164,131.00 | 0.24 |
| 112 | 002155 | 湖南黄金 | 9,048 | 163,768.80 | 0.24 |
| 113 | 603345 | 安井食品 | 2,200 | 163,482.00 | 0.24 |
| 114 | 603338 | 浙江鼎力 | 2,700 | 163,134.00 | 0.24 |
| 115 | 300037 | 新宙邦 | 5,700 | 162,792.00 | 0.24 |
| 116 | 601696 | 中银证券 | 17,900 | 162,532.00 | 0.24 |
| 117 | 600863 | 内蒙华电 | 35,000 | 162,400.00 | 0.24 |
| 118 | 300724 | 捷佳伟创 | 3,000 | 162,030.00 | 0.24 |
| 119 | 601162 | 天风证券 | 74,300 | 161,974.00 | 0.24 |
| 120 | 000921 | 海信家电 | 5,000 | 161,200.00 | 0.24 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 121 | 002472 | 双环传动 | 7,300 | 160,746.00 | 0.24 |
| 122 | 600038 | 中直股份 | 3,900 | 160,329.00 | 0.23 |
| 123 | 600521 | 华海药业 | 9,400 | 160,270.00 | 0.23 |
| 124 | 002294 | 信立泰 | 6,000 | 159,780.00 | 0.23 |
| 125 | 300866 | 安克创新 | 2,240 | 159,510.40 | 0.23 |
| 126 | 002984 | 森麒麟 | 6,600 | 158,994.00 | 0.23 |
| 127 | 300001 | 特锐德 | 7,900 | 158,948.00 | 0.23 |
| 128 | 603939 | 益丰药房 | 6,452 | 158,396.60 | 0.23 |
| 129 | 600141 | 兴发集团 | 8,300 | 158,364.00 | 0.23 |
| 130 | 600549 | 厦门钨业 | 9,100 | 156,975.00 | 0.23 |
| 131 | 002407 | 多氟多 | 12,820 | 156,788.60 | 0.23 |
| 132 | 600699 | 均胜电子 | 10,540 | 156,202.80 | 0.23 |
| 133 | 600546 | 山煤国际 | 10,600 | 154,972.00 | 0.23 |
| 134 | 300699 | 光威复材 | 6,220 | 154,442.60 | 0.23 |
| 135 | 002262 | 恩华药业 | 6,500 | 154,310.00 | 0.23 |
| 136 | 301358 | 湖南裕能 | 4,900 | 154,154.00 | 0.23 |
| 137 | 600820 | 隧道股份 | 23,600 | 154,108.00 | 0.23 |
| 138 | 300285 | 国瓷材料 | 8,600 | 153,510.00 | 0.22 |
| 139 | 600895 | 张江高科 | 8,300 | 153,384.00 | 0.22 |
| 140 | 600369 | 西南证券 | 42,800 | 153,224.00 | 0.22 |
| 141 | 002195 | 岩山科技 | 60,950 | 152,984.50 | 0.22 |
| 142 | 603589 | 口子窖 | 3,900 | 152,841.00 | 0.22 |
| 143 | 002850 | 科达利 | 2,000 | 152,760.00 | 0.22 |
| 144 | 002064 | 华峰化学 | 21,300 | 152,721.00 | 0.22 |
| 145 | 600872 | 中炬高新 | 6,700 | 152,023.00 | 0.22 |
| 146 | 000021 | 深科技 | 10,000 | 151,200.00 | 0.22 |
| 147 | 601000 | 唐山港 | 31,800 | 149,460.00 | 0.22 |
| 148 | 600021 | 上海电力 | 15,100 | 149,339.00 | 0.22 |
| 149 | 000513 | 丽珠集团 | 4,000 | 148,840.00 | 0.22 |
| 150 | 600486 | 扬农化工 | 2,630 | 148,463.50 | 0.22 |
| 151 | 603087 | 甘李药业 | 3,200 | 148,224.00 | 0.22 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 152 | 300146 | 汤臣倍健 | 10,900 | 147,695.00 | 0.22 |
| 153 | 300073 | 当升科技 | 4,300 | 147,533.00 | 0.22 |
| 154 | 688188 | 柏楚电子 | 792 | 146,163.60 | 0.21 |
| 155 | 688065 | 凯赛生物 | 3,200 | 145,248.00 | 0.21 |
| 155 | 300058 | 蓝色光标 | 26,700 | 145,248.00 | 0.21 |
| 157 | 603179 | 新泉股份 | 3,700 | 145,188.00 | 0.21 |
| 158 | 601966 | 玲珑轮胎 | 7,900 | 145,123.00 | 0.21 |
| 159 | 600704 | 物产中大 | 33,400 | 144,956.00 | 0.21 |
| 160 | 300114 | 中航电测 | 3,200 | 144,800.00 | 0.21 |
| 161 | 600153 | 建发股份 | 16,100 | 143,773.00 | 0.21 |
| 162 | 600155 | 华创云信 | 24,247 | 143,299.77 | 0.21 |
| 163 | 002756 | 永兴材料 | 4,000 | 143,120.00 | 0.21 |
| 164 | 000830 | 鲁西化工 | 12,300 | 142,557.00 | 0.21 |
| 165 | 300529 | 健帆生物 | 5,200 | 141,492.00 | 0.21 |
| 166 | 600583 | 海油工程 | 23,700 | 140,067.00 | 0.21 |
| 167 | 600118 | 中国卫星 | 6,300 | 140,049.00 | 0.21 |
| 168 | 002558 | 巨人网络 | 14,800 | 139,712.00 | 0.20 |
| 169 | 002152 | 广电运通 | 13,300 | 139,118.00 | 0.20 |
| 170 | 601156 | 东航物流 | 6,800 | 138,380.00 | 0.20 |
| 171 | 000591 | 太阳能 | 29,300 | 138,003.00 | 0.20 |
| 172 | 000623 | 吉林敖东 | 10,218 | 136,921.20 | 0.20 |
| 173 | 600970 | 中材国际 | 11,300 | 136,278.00 | 0.20 |
| 174 | 300373 | 扬杰科技 | 3,500 | 136,150.00 | 0.20 |
| 175 | 002385 | 大北农 | 35,300 | 135,905.00 | 0.20 |
| 176 | 300144 | 宋城演艺 | 16,900 | 135,707.00 | 0.20 |
| 177 | 002439 | 启明星辰 | 7,800 | 134,628.00 | 0.20 |
| 178 | 002025 | 航天电器 | 2,900 | 134,502.00 | 0.20 |
| 179 | 605358 | 立昂微 | 5,800 | 134,212.00 | 0.20 |
| 180 | 600380 | 健康元 | 12,000 | 134,040.00 | 0.20 |
| 181 | 601216 | 君正集团 | 36,200 | 133,578.00 | 0.20 |
| 182 | 000729 | 燕京啤酒 | 15,100 | 133,333.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 183 | 000723 | 美锦能源 | 27,800 | 132,328.00 | 0.19 |
| 184 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,148 | 132,284.04 | 0.19 |
| 185 | 600143 | 金发科技 | 20,000 | 132,200.00 | 0.19 |
| 186 | 600998 | 九州通 | 27,074 | 132,121.12 | 0.19 |
| 187 | 300251 | 光线传媒 | 15,700 | 132,037.00 | 0.19 |
| 188 | 000519 | 中兵红箭 | 9,000 | 132,030.00 | 0.19 |
| 189 | 600282 | 南钢股份 | 26,400 | 131,472.00 | 0.19 |
| 190 | 300677 | 英科医疗 | 4,900 | 131,369.00 | 0.19 |
| 191 | 600637 | 东方明珠 | 21,600 | 131,328.00 | 0.19 |
| 192 | 600516 | 方大炭素 | 30,200 | 130,162.00 | 0.19 |
| 193 | 300383 | 光环新网 | 15,400 | 130,130.00 | 0.19 |
| 194 | 600763 | 通策医疗 | 2,400 | 129,720.00 | 0.19 |
| 195 | 300024 | 机器人 | 13,300 | 129,542.00 | 0.19 |
| 196 | 600392 | 盛和资源 | 15,000 | 129,300.00 | 0.19 |
| 197 | 000636 | 风华高科 | 9,900 | 129,294.00 | 0.19 |
| 198 | 000818 | 航锦科技 | 5,800 | 128,064.00 | 0.19 |
| 199 | 600909 | 华安证券 | 30,220 | 127,226.20 | 0.19 |
| 200 | 601665 | 齐鲁银行 | 25,900 | 127,169.00 | 0.19 |
| 201 | 002044 | 美年健康 | 33,600 | 127,008.00 | 0.19 |
| 202 | 600566 | 济川药业 | 4,000 | 126,840.00 | 0.19 |
| 203 | 600008 | 首创环保 | 47,200 | 126,496.00 | 0.19 |
| 204 | 000883 | 湖北能源 | 21,000 | 126,210.00 | 0.18 |
| 205 | 688213 | 思特威 | 2,600 | 126,100.00 | 0.18 |
| 206 | 600867 | 通化东宝 | 14,900 | 124,713.00 | 0.18 |
| 207 | 601016 | 节能风电 | 41,700 | 124,683.00 | 0.18 |
| 208 | 000629 | 钒钛股份 | 49,800 | 124,500.00 | 0.18 |
| 209 | 300088 | 长信科技 | 26,300 | 123,610.00 | 0.18 |
| 210 | 601456 | 国联证券 | 12,800 | 123,392.00 | 0.18 |
| 211 | 600511 | 国药股份 | 4,000 | 123,160.00 | 0.18 |
| 212 | 000997 | 新大陆 | 8,850 | 123,103.50 | 0.18 |
| 213 | 600170 | 上海建工 | 57,200 | 122,980.00 | 0.18 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 214 | 600582 | 天地科技 | 17,800 | 122,642.00 | 0.18 |
| 215 | 600129 | 太极集团 | 4,200 | 121,464.00 | 0.18 |
| 216 | 600499 | 科达制造 | 14,400 | 121,392.00 | 0.18 |
| 217 | 600498 | 烽火通信 | 7,600 | 120,840.00 | 0.18 |
| 218 | 601933 | 永辉超市 | 48,700 | 120,776.00 | 0.18 |
| 219 | 600535 | 天士力 | 9,600 | 120,768.00 | 0.18 |
| 220 | 600004 | 白云机场 | 12,700 | 120,396.00 | 0.18 |
| 221 | 000598 | 兴蓉环境 | 16,000 | 120,320.00 | 0.18 |
| 222 | 601991 | 大唐发电 | 39,900 | 120,099.00 | 0.18 |
| 223 | 002120 | 韵达股份 | 15,500 | 119,970.00 | 0.18 |
| 224 | 000750 | 国海证券 | 41,100 | 119,601.00 | 0.18 |
| 225 | 002261 | 拓维信息 | 10,800 | 119,556.00 | 0.18 |
| 226 | 000060 | 中金岭南 | 28,100 | 119,144.00 | 0.17 |
| 227 | 600580 | 卧龙电驱 | 9,800 | 119,070.00 | 0.17 |
| 228 | 300567 | 精测电子 | 2,100 | 118,671.00 | 0.17 |
| 229 | 300118 | 东方日升 | 9,800 | 118,580.00 | 0.17 |
| 230 | 300568 | 星源材质 | 14,400 | 118,080.00 | 0.17 |
| 231 | 603486 | 科沃斯 | 2,500 | 117,950.00 | 0.17 |
| 232 | 603000 | 人民网 | 5,900 | 117,941.00 | 0.17 |
| 233 | 002430 | 杭氧股份 | 5,300 | 117,925.00 | 0.17 |
| 234 | 688052 | 纳芯微 | 1,146 | 117,785.88 | 0.17 |
| 235 | 002429 | 兆驰股份 | 24,300 | 116,883.00 | 0.17 |
| 236 | 603228 | 景旺电子 | 3,647 | 115,974.60 | 0.17 |
| 237 | 002939 | 长城证券 | 17,300 | 115,910.00 | 0.17 |
| 238 | 600166 | 福田汽车 | 51,500 | 115,875.00 | 0.17 |
| 239 | 603658 | 安图生物 | 2,500 | 115,175.00 | 0.17 |
| 240 | 600325 | 华发股份 | 17,700 | 115,050.00 | 0.17 |
| 241 | 603156 | 养元饮品 | 5,400 | 114,858.00 | 0.17 |
| 242 | 600816 | 建元信托 | 42,200 | 114,362.00 | 0.17 |
| 243 | 600673 | 东阳光 | 16,200 | 114,048.00 | 0.17 |
| 244 | 601231 | 环旭电子 | 7,100 | 113,955.00 | 0.17 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 245 | 603568 | 伟明环保 | 5,526 | 113,725.08 | 0.17 |
| 246 | 300765 | 新诺威 | 4,500 | 113,535.00 | 0.17 |
| 247 | 603927 | 中科软 | 6,256 | 113,171.04 | 0.17 |
| 248 | 000893 | 亚钾国际 | 7,000 | 113,120.00 | 0.17 |
| 249 | 300487 | 蓝晓科技 | 2,700 | 112,752.00 | 0.17 |
| 250 | 002508 | 老板电器 | 5,100 | 112,710.00 | 0.17 |
| 251 | 600754 | 锦江酒店 | 4,900 | 112,602.00 | 0.16 |
| 252 | 300601 | 康泰生物 | 7,200 | 112,392.00 | 0.16 |
| 253 | 603290 | 斯达半导 | 1,300 | 111,943.00 | 0.16 |
| 254 | 000027 | 深圳能源 | 15,320 | 111,836.00 | 0.16 |
| 255 | 601636 | 旗滨集团 | 17,300 | 111,585.00 | 0.16 |
| 256 | 002926 | 华西证券 | 16,900 | 111,371.00 | 0.16 |
| 257 | 000998 | 隆平高科 | 11,300 | 111,079.00 | 0.16 |
| 258 | 002624 | 完美世界 | 14,600 | 110,960.00 | 0.16 |
| 259 | 002497 | 雅化集团 | 12,400 | 110,608.00 | 0.16 |
| 260 | 002653 | 海思科 | 3,600 | 110,520.00 | 0.16 |
| 261 | 688114 | 华大智造 | 2,328 | 110,370.48 | 0.16 |
| 262 | 600737 | 中粮糖业 | 11,500 | 110,285.00 | 0.16 |
| 263 | 603298 | 杭叉集团 | 5,600 | 109,984.00 | 0.16 |
| 264 | 601866 | 中远海发 | 42,500 | 109,650.00 | 0.16 |
| 265 | 603077 | 和邦生物 | 66,300 | 109,395.00 | 0.16 |
| 266 | 300253 | 卫宁健康 | 18,500 | 109,150.00 | 0.16 |
| 267 | 002299 | 圣农发展 | 8,000 | 109,120.00 | 0.16 |
| 268 | 688002 | 睿创微纳 | 3,900 | 109,083.00 | 0.16 |
| 269 | 002065 | 东华软件 | 24,100 | 108,932.00 | 0.16 |
| 270 | 300604 | 长川科技 | 4,000 | 108,680.00 | 0.16 |
| 271 | 300390 | 天华新能 | 6,320 | 108,577.60 | 0.16 |
| 272 | 002500 | 山西证券 | 23,100 | 108,570.00 | 0.16 |
| 273 | 002056 | 横店东磁 | 8,700 | 108,489.00 | 0.16 |
| 274 | 601958 | 金钼股份 | 10,400 | 108,264.00 | 0.16 |
| 274 | 300763 | 锦浪科技 | 2,600 | 108,264.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 276 | 600373 | 中文传媒 | 7,294 | 108,242.96 | 0.16 |
| 277 | 600131 | 国网信通 | 6,400 | 107,968.00 | 0.16 |
| 278 | 002414 | 高德红外 | 18,300 | 107,787.00 | 0.16 |
| 279 | 600655 | 豫园股份 | 20,900 | 107,635.00 | 0.16 |
| 280 | 688772 | 珠海冠宇 | 7,202 | 107,309.80 | 0.16 |
| 281 | 300009 | 安科生物 | 12,556 | 107,228.24 | 0.16 |
| 282 | 688385 | 复旦微电 | 3,400 | 106,692.00 | 0.16 |
| 283 | 600563 | 法拉电子 | 1,400 | 106,652.00 | 0.16 |
| 284 | 603893 | 瑞芯微 | 1,800 | 106,506.00 | 0.16 |
| 285 | 002368 | 太极股份 | 4,720 | 106,436.00 | 0.16 |
| 286 | 002507 | 涪陵榨菜 | 8,650 | 105,962.50 | 0.16 |
| 287 | 600707 | 彩虹股份 | 15,400 | 104,874.00 | 0.15 |
| 288 | 002372 | 伟星新材 | 6,800 | 104,856.00 | 0.15 |
| 289 | 603885 | 吉祥航空 | 9,500 | 104,405.00 | 0.15 |
| 290 | 601611 | 中国核建 | 12,900 | 104,361.00 | 0.15 |
| 291 | 688390 | 固德威 | 1,859 | 104,327.08 | 0.15 |
| 292 | 000887 | 中鼎股份 | 8,470 | 103,672.80 | 0.15 |
| 293 | 603379 | 三美股份 | 2,620 | 102,546.80 | 0.15 |
| 294 | 002203 | 海亮股份 | 12,807 | 102,199.86 | 0.15 |
| 295 | 002831 | 裕同科技 | 3,989 | 102,078.51 | 0.15 |
| 296 | 600755 | 厦门国贸 | 14,200 | 101,814.00 | 0.15 |
| 297 | 688521 | 芯原股份 | 3,800 | 101,650.00 | 0.15 |
| 298 | 603225 | 新凤鸣 | 6,520 | 101,646.80 | 0.15 |
| 299 | 600329 | 达仁堂 | 3,100 | 100,409.00 | 0.15 |
| 300 | 600859 | 王府井 | 8,500 | 99,790.00 | 0.15 |
| 301 | 600995 | 南网储能 | 10,300 | 99,498.00 | 0.15 |
| 302 | 601880 | 辽港股份 | 80,800 | 99,384.00 | 0.15 |
| 303 | 600801 | 华新水泥 | 7,200 | 99,000.00 | 0.14 |
| 304 | 002683 | 广东宏大 | 4,900 | 98,637.00 | 0.14 |
| 305 | 600416 | 湘电股份 | 9,900 | 98,406.00 | 0.14 |
| 306 | 600884 | 杉杉股份 | 12,100 | 98,252.00 | 0.14 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 307 | 300296 | 利亚德 | 21,700 | 97,650.00 | 0.14 |
| 308 | 002019 | 亿帆医药 | 7,900 | 97,644.00 | 0.14 |
| 309 | 300070 | 碧水源 | 23,300 | 97,627.00 | 0.14 |
| 310 | 600390 | 五矿资本 | 24,100 | 97,605.00 | 0.14 |
| 311 | 600435 | 北方导航 | 11,302 | 97,423.24 | 0.14 |
| 312 | 002506 | 协鑫集成 | 50,200 | 97,388.00 | 0.14 |
| 313 | 002244 | 滨江集团 | 13,300 | 96,558.00 | 0.14 |
| 314 | 600739 | 辽宁成大 | 11,500 | 96,255.00 | 0.14 |
| 315 | 000050 | 深天马 A | 13,200 | 96,096.00 | 0.14 |
| 316 | 600483 | 福能股份 | 8,200 | 95,612.00 | 0.14 |
| 317 | 601098 | 中南传媒 | 7,690 | 95,509.80 | 0.14 |
| 318 | 601598 | 中国外运 | 16,900 | 95,147.00 | 0.14 |
| 318 | 600399 | 抚顺特钢 | 16,900 | 95,147.00 | 0.14 |
| 320 | 300748 | 金力永磁 | 7,340 | 95,126.40 | 0.14 |
| 321 | 002572 | 索菲亚 | 6,200 | 95,046.00 | 0.14 |
| 322 | 600598 | 北大荒 | 7,600 | 94,924.00 | 0.14 |
| 323 | 300803 | 指南针 | 2,600 | 94,666.00 | 0.14 |
| 324 | 600901 | 江苏金租 | 18,720 | 94,536.00 | 0.14 |
| 325 | 300676 | 华大基因 | 2,700 | 94,527.00 | 0.14 |
| 326 | 002568 | 百润股份 | 5,600 | 94,248.00 | 0.14 |
| 327 | 600848 | 上海临港 | 10,300 | 93,833.00 | 0.14 |
| 328 | 002487 | 大金重工 | 4,100 | 93,808.00 | 0.14 |
| 329 | 000155 | 川能动力 | 8,700 | 93,699.00 | 0.14 |
| 330 | 002080 | 中材科技 | 7,200 | 92,880.00 | 0.14 |
| 331 | 002240 | 盛新锂能 | 6,900 | 92,598.00 | 0.14 |
| 332 | 002373 | 千方科技 | 10,200 | 92,514.00 | 0.14 |
| 333 | 001286 | 陕西能源 | 8,000 | 92,240.00 | 0.14 |
| 334 | 002936 | 郑州银行 | 53,090 | 91,845.70 | 0.13 |
| 335 | 002557 | 洽洽食品 | 3,252 | 91,673.88 | 0.13 |
| 336 | 603712 | 七一二 | 5,000 | 90,950.00 | 0.13 |
| 337 | 300595 | 欧普康视 | 5,800 | 90,944.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 338 | 000563 | 陕国投 A | 32,900 | 90,475.00 | 0.13 |
| 339 | 601928 | 凤凰传媒 | 8,200 | 89,872.00 | 0.13 |
| 340 | 600968 | 海油发展 | 21,800 | 89,816.00 | 0.13 |
| 341 | 002268 | 电科网安 | 6,300 | 89,649.00 | 0.13 |
| 342 | 000778 | 新兴铸管 | 25,700 | 89,436.00 | 0.13 |
| 343 | 603858 | 步长制药 | 5,900 | 89,385.00 | 0.13 |
| 344 | 600258 | 首旅酒店 | 7,220 | 89,167.00 | 0.13 |
| 345 | 688234 | 天岳先进 | 1,900 | 89,148.00 | 0.13 |
| 346 | 603883 | 老百姓 | 4,849 | 89,027.64 | 0.13 |
| 347 | 603444 | 吉比特 | 500 | 89,005.00 | 0.13 |
| 348 | 601212 | 白银有色 | 31,800 | 88,404.00 | 0.13 |
| 349 | 688538 | 和辉光电 | 44,476 | 88,062.48 | 0.13 |
| 350 | 688536 | 思瑞浦 | 900 | 88,029.00 | 0.13 |
| 351 | 300558 | 贝达药业 | 2,700 | 87,885.00 | 0.13 |
| 352 | 600271 | 航天信息 | 11,900 | 87,584.00 | 0.13 |
| 353 | 603688 | 石英股份 | 2,950 | 87,349.50 | 0.13 |
| 354 | 600062 | 华润双鹤 | 4,460 | 87,326.80 | 0.13 |
| 355 | 600528 | 中铁工业 | 11,900 | 87,108.00 | 0.13 |
| 356 | 688331 | 荣昌生物 | 2,000 | 86,400.00 | 0.13 |
| 357 | 600977 | 中国电影 | 8,000 | 86,080.00 | 0.13 |
| 358 | 601155 | 新城控股 | 9,700 | 86,039.00 | 0.13 |
| 359 | 000709 | 河钢股份 | 44,300 | 85,942.00 | 0.13 |
| 360 | 002531 | 天顺风能 | 9,600 | 85,824.00 | 0.13 |
| 361 | 000739 | 普洛药业 | 6,300 | 85,491.00 | 0.13 |
| 362 | 002408 | 齐翔腾达 | 15,240 | 85,344.00 | 0.12 |
| 363 | 600959 | 江苏有线 | 32,200 | 85,008.00 | 0.12 |
| 364 | 600378 | 昊华科技 | 2,900 | 83,810.00 | 0.12 |
| 365 | 688005 | 容百科技 | 3,600 | 83,808.00 | 0.12 |
| 366 | 601118 | 海南橡胶 | 18,400 | 83,720.00 | 0.12 |
| 367 | 000825 | 太钢不锈 | 24,500 | 82,810.00 | 0.12 |
| 368 | 688220 | 翱捷科技 | 2,200 | 82,412.00 | 0.12 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 369 | 688017 | 绿的谐波 | 1,000 | 82,100.00 | 0.12 |
| 370 | 603737 | 三棵树 | 2,260 | 81,970.20 | 0.12 |
| 371 | 603882 | 金域医学 | 3,000 | 81,570.00 | 0.12 |
| 372 | 600612 | 老凤祥 | 1,400 | 81,466.00 | 0.12 |
| 373 | 600056 | 中国医药 | 8,020 | 81,162.40 | 0.12 |
| 374 | 000987 | 越秀资本 | 16,185 | 80,277.60 | 0.12 |
| 375 | 600906 | 财达证券 | 13,930 | 79,818.90 | 0.12 |
| 376 | 601399 | 国机重装 | 30,900 | 79,722.00 | 0.12 |
| 377 | 600517 | 国网英大 | 18,400 | 79,672.00 | 0.12 |
| 378 | 603456 | 九洲药业 | 5,800 | 79,576.00 | 0.12 |
| 379 | 601019 | 山东出版 | 6,700 | 79,194.00 | 0.12 |
| 380 | 300212 | 易华录 | 4,700 | 79,101.00 | 0.12 |
| 381 | 002266 | 浙富控股 | 28,000 | 78,120.00 | 0.11 |
| 382 | 688063 | 派能科技 | 1,960 | 77,831.60 | 0.11 |
| 383 | 603650 | 彤程新材 | 2,600 | 76,830.00 | 0.11 |
| 384 | 600316 | 洪都航空 | 4,600 | 76,498.00 | 0.11 |
| 385 | 000937 | 冀中能源 | 11,400 | 76,380.00 | 0.11 |
| 386 | 600871 | 石化油服 | 43,700 | 76,038.00 | 0.11 |
| 387 | 600925 | 苏能股份 | 14,800 | 74,740.00 | 0.11 |
| 388 | 688567 | 孚能科技 | 7,784 | 74,726.40 | 0.11 |
| 389 | 002423 | 中粮资本 | 9,900 | 74,151.00 | 0.11 |
| 390 | 000032 | 深桑达A | 4,900 | 73,402.00 | 0.11 |
| 391 | 688200 | 华峰测控 | 800 | 73,400.00 | 0.11 |
| 392 | 601965 | 中国汽研 | 4,300 | 72,627.00 | 0.11 |
| 393 | 001227 | 兰州银行 | 30,500 | 72,590.00 | 0.11 |
| 394 | 603728 | 鸣志电器 | 1,800 | 72,414.00 | 0.11 |
| 395 | 600098 | 广州发展 | 11,300 | 72,320.00 | 0.11 |
| 396 | 600208 | 新湖中宝 | 45,600 | 72,048.00 | 0.11 |
| 397 | 601298 | 青岛港 | 7,500 | 71,700.00 | 0.10 |
| 398 | 688561 | 奇安信 | 3,000 | 70,860.00 | 0.10 |
| 399 | 002607 | 中公教育 | 46,300 | 70,839.00 | 0.10 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 400 | 601608 | 中信重工 | 18,583 | 70,801.23 | 0.10 |
| 401 | 688516 | 奥特维 | 1,692 | 70,742.52 | 0.10 |
| 402 | 600663 | 陆家嘴 | 8,000 | 70,560.00 | 0.10 |
| 403 | 002670 | 国盛金控 | 8,300 | 70,301.00 | 0.10 |
| 404 | 688297 | 中无人机 | 2,127 | 70,254.81 | 0.10 |
| 405 | 603233 | 大参林 | 4,900 | 70,070.00 | 0.10 |
| 406 | 600022 | 山东钢铁 | 57,360 | 69,979.20 | 0.10 |
| 407 | 300438 | 鹏辉能源 | 3,800 | 69,692.00 | 0.10 |
| 408 | 600578 | 京能电力 | 21,500 | 69,660.00 | 0.10 |
| 409 | 300776 | 帝尔激光 | 1,500 | 68,940.00 | 0.10 |
| 410 | 300357 | 我武生物 | 3,400 | 68,748.00 | 0.10 |
| 411 | 003031 | 中瓷电子 | 1,480 | 68,435.20 | 0.10 |
| 412 | 688032 | 禾迈股份 | 596 | 68,408.88 | 0.10 |
| 413 | 601106 | 中国一重 | 29,400 | 67,914.00 | 0.10 |
| 414 | 600500 | 中化国际 | 19,200 | 67,008.00 | 0.10 |
| 415 | 600377 | 宁沪高速 | 5,300 | 66,780.00 | 0.10 |
| 416 | 000785 | 居然之家 | 27,000 | 65,610.00 | 0.10 |
| 417 | 600967 | 内蒙一机 | 9,100 | 65,520.00 | 0.10 |
| 418 | 002865 | 钧达股份 | 1,700 | 65,246.00 | 0.10 |
| 419 | 600350 | 山东高速 | 7,300 | 64,605.00 | 0.09 |
| 420 | 600315 | 上海家化 | 3,600 | 64,008.00 | 0.09 |
| 421 | 688349 | 三一重能 | 2,568 | 63,789.12 | 0.09 |
| 422 | 300888 | 稳健医疗 | 2,520 | 63,756.00 | 0.09 |
| 423 | 600827 | 百联股份 | 8,615 | 63,578.70 | 0.09 |
| 424 | 601568 | 北元集团 | 17,080 | 63,366.80 | 0.09 |
| 425 | 000958 | 电投产融 | 17,300 | 63,318.00 | 0.09 |
| 426 | 688425 | 铁建重工 | 17,200 | 63,296.00 | 0.09 |
| 427 | 000537 | 中绿电 | 6,640 | 63,279.20 | 0.09 |
| 428 | 000559 | 万向钱潮 | 14,183 | 63,256.18 | 0.09 |
| 429 | 002690 | 美亚光电 | 3,811 | 62,881.50 | 0.09 |
| 430 | 688029 | 南微医学 | 1,020 | 62,791.20 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 431 | 002608 | 江苏国信 | 8,100 | 62,775.00 | 0.09 |
| 432 | 000156 | 华数传媒 | 9,900 | 62,172.00 | 0.09 |
| 433 | 002867 | 周大生 | 4,750 | 62,035.00 | 0.09 |
| 434 | 603517 | 绝味食品 | 4,000 | 61,600.00 | 0.09 |
| 435 | 603707 | 健友股份 | 5,162 | 61,324.56 | 0.09 |
| 436 | 601992 | 金隅集团 | 44,700 | 61,239.00 | 0.09 |
| 437 | 603826 | 坤彩科技 | 2,100 | 60,837.00 | 0.09 |
| 438 | 600126 | 杭钢股份 | 14,500 | 59,595.00 | 0.09 |
| 439 | 300682 | 朗新集团 | 7,000 | 59,570.00 | 0.09 |
| 440 | 688778 | 厦钨新能 | 1,900 | 59,356.00 | 0.09 |
| 441 | 003022 | 联泓新科 | 4,300 | 58,953.00 | 0.09 |
| 442 | 603786 | 科博达 | 900 | 57,735.00 | 0.08 |
| 443 | 000967 | 盈峰环境 | 13,600 | 57,528.00 | 0.08 |
| 444 | 603218 | 日月股份 | 5,500 | 56,485.00 | 0.08 |
| 445 | 600339 | 中油工程 | 18,000 | 56,160.00 | 0.08 |
| 446 | 600032 | 浙江新能 | 7,700 | 56,056.00 | 0.08 |
| 447 | 600481 | 双良节能 | 12,000 | 56,040.00 | 0.08 |
| 448 | 600361 | 创新新材 | 13,900 | 56,017.00 | 0.08 |
| 449 | 301267 | 华夏眼科 | 2,700 | 55,944.00 | 0.08 |
| 450 | 600095 | 湘财股份 | 9,200 | 54,832.00 | 0.08 |
| 451 | 688475 | 萤石网络 | 1,600 | 54,576.00 | 0.08 |
| 452 | 000898 | 鞍钢股份 | 25,600 | 54,272.00 | 0.08 |
| 453 | 003035 | 南网能源 | 12,200 | 53,680.00 | 0.08 |
| 454 | 603127 | 昭衍新药 | 4,020 | 53,345.40 | 0.08 |
| 455 | 688248 | 南网科技 | 1,800 | 53,334.00 | 0.08 |
| 456 | 688520 | 神州细胞 | 1,350 | 53,122.50 | 0.08 |
| 457 | 600808 | 马钢股份 | 25,800 | 52,116.00 | 0.08 |
| 458 | 002563 | 森马服饰 | 8,700 | 50,547.00 | 0.07 |
| 459 | 002153 | 石基信息 | 8,820 | 50,538.60 | 0.07 |
| 460 | 603185 | 弘元绿能 | 2,900 | 49,561.00 | 0.07 |
| 461 | 601228 | 广州港 | 16,200 | 49,410.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 462 | 000539 | 粤电力 A | 9,500 | 48,260.00 | 0.07 |
| 463 | 688779 | 长远锂科 | 10,400 | 48,152.00 | 0.07 |
| 464 | 001872 | 招商港口 | 2,500 | 48,125.00 | 0.07 |
| 465 | 001203 | 大中矿业 | 4,900 | 47,089.00 | 0.07 |
| 466 | 600928 | 西安银行 | 14,300 | 46,761.00 | 0.07 |
| 467 | 688281 | 华秦科技 | 560 | 46,659.20 | 0.07 |
| 468 | 688006 | 杭可科技 | 2,660 | 46,417.00 | 0.07 |
| 469 | 000401 | 冀东水泥 | 11,400 | 46,284.00 | 0.07 |
| 470 | 000959 | 首钢股份 | 16,700 | 45,424.00 | 0.07 |
| 471 | 600764 | 中国海防 | 2,300 | 45,149.00 | 0.07 |
| 472 | 002518 | 科士达 | 2,500 | 44,250.00 | 0.06 |
| 473 | 603056 | 德邦股份 | 3,300 | 43,230.00 | 0.06 |
| 474 | 688375 | 国博电子 | 600 | 42,384.00 | 0.06 |
| 475 | 603305 | 旭升集团 | 4,000 | 42,240.00 | 0.06 |
| 476 | 688172 | 燕东微 | 2,600 | 42,068.00 | 0.06 |
| 477 | 600299 | 安迪苏 | 4,300 | 41,710.00 | 0.06 |
| 478 | 601139 | 深圳燃气 | 6,200 | 41,416.00 | 0.06 |
| 479 | 300861 | 美畅股份 | 2,100 | 40,635.00 | 0.06 |
| 480 | 688276 | 百克生物 | 1,400 | 39,718.00 | 0.06 |
| 481 | 603317 | 天味食品 | 3,399 | 38,782.59 | 0.06 |
| 482 | 688387 | 信科移动 | 7,400 | 37,296.00 | 0.05 |
| 483 | 301029 | 怡合达 | 1,860 | 36,567.60 | 0.05 |
| 484 | 002791 | 坚朗五金 | 1,400 | 36,218.00 | 0.05 |
| 485 | 600927 | 永安期货 | 3,100 | 34,565.00 | 0.05 |
| 486 | 688819 | 天能股份 | 1,448 | 34,549.28 | 0.05 |
| 487 | 601858 | 中国科传 | 1,700 | 32,504.00 | 0.05 |
| 488 | 000031 | 大悦城 | 13,767 | 32,214.78 | 0.05 |
| 489 | 688107 | 安路科技 | 1,200 | 30,504.00 | 0.04 |
| 490 | 601158 | 重庆水务 | 6,200 | 29,760.00 | 0.04 |
| 491 | 688153 | 唯捷创芯 | 800 | 29,600.00 | 0.04 |
| 492 | 601828 | 美凯龙 | 11,600 | 29,580.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 493 | 002945 | 华林证券 | 2,900 | 28,942.00 | 0.04 |
| 494 | 688348 | 昱能科技 | 490 | 28,910.00 | 0.04 |
| 495 | 600956 | 新天绿能 | 3,300 | 26,961.00 | 0.04 |
| 496 | 301165 | 锐捷网络 | 700 | 20,888.00 | 0.03 |
| 497 | 688295 | 中复神鹰 | 1,000 | 20,300.00 | 0.03 |
| 498 | 603868 | 飞科电器 | 500 | 19,200.00 | 0.03 |

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 | 000540 | *ST中天 | 27,500 | - | 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 | 300502 | 新易盛 | 354,643.00 | 1.01 |
| 2 | 601077 | 渝农商行 | 324,191.00 | 0.92 |
| 3 | 688777 | 中控技术 | 283,820.79 | 0.81 |
| 4 | 601058 | 赛轮轮胎 | 271,009.00 | 0.77 |
| 5 | 002422 | 科伦药业 | 266,305.00 | 0.76 |
| 6 | 688617 | 惠泰医疗 | 264,411.80 | 0.75 |
| 7 | 603529 | 爱玛科技 | 255,999.00 | 0.73 |
| 8 | 002028 | 思源电气 | 254,080.00 | 0.72 |
| 9 | 688169 | 石头科技 | 252,332.00 | 0.72 |
| 10 | 601567 | 三星医疗 | 251,806.00 | 0.72 |
| 11 | 002463 | 沪电股份 | 248,964.00 | 0.71 |
| 12 | 002202 | 金风科技 | 225,256.00 | 0.64 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 13 | 601168 | 西部矿业 | 218,156.00 | 0.62 |
| 14 | 000933 | 神火股份 | 216,077.00 | 0.62 |
| 15 | 300394 | 天孚通信 | 213,532.00 | 0.61 |
| 16 | 000975 | 银泰黄金 | 213,284.00 | 0.61 |
| 17 | 601615 | 明阳智能 | 211,550.00 | 0.60 |
| 18 | 600066 | 宇通客车 | 209,791.00 | 0.60 |
| 19 | 603979 | 金诚信 | 205,800.00 | 0.59 |
| 20 | 002436 | 兴森科技 | 204,168.00 | 0.58 |

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 | 002463 | 沪电股份 | 543,493.00 | 1.55 |
| 2 | 002422 | 科伦药业 | 453,445.00 | 1.29 |
| 3 | 000975 | 银泰黄金 | 360,862.00 | 1.03 |
| 4 | 600160 | 巨化股份 | 337,734.24 | 0.96 |
| 5 | 300418 | 昆仑万维 | 323,598.00 | 0.92 |
| 6 | 600161 | 天坛生物 | 282,600.00 | 0.81 |
| 7 | 600415 | 小商品城 | 247,265.00 | 0.70 |
| 8 | 688072 | 拓荆科技 | 226,194.75 | 0.64 |
| 9 | 600482 | 中国动力 | 223,067.00 | 0.64 |
| 10 | 002600 | 领益智造 | 157,483.00 | 0.45 |
| 11 | 688728 | 格科微 | 112,476.00 | 0.32 |
| 12 | 002966 | 苏州银行 | 108,394.00 | 0.31 |
| 13 | 000581 | 威孚高科 | 104,052.00 | 0.30 |
| 14 | 002131 | 利欧股份 | 103,043.00 | 0.29 |
| 15 | 002032 | 苏泊尔 | 97,110.00 | 0.28 |
| 16 | 000547 | 航天发展 | 90,551.21 | 0.26 |

| | | | | |
|----|--------|------|-----------|------|
| 17 | 601187 | 厦门银行 | 88,006.00 | 0.25 |
| 18 | 300026 | 红日药业 | 86,548.00 | 0.25 |
| 19 | 000970 | 中科三环 | 85,626.00 | 0.24 |
| 20 | 601778 | 晶科科技 | 84,037.00 | 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 | 45,162,446.19 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 8,241,410.99 |

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 | 3,431,137.64 | 5.02 |
| 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) | 13,000.97 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,444,138.61 | 5.04 |

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 | 019740 | 24国债09 | 18,000 | 1,806,153.53 | 2.64 |

| | | | | | |
|---|--------|--------|--------|--------------|------|
| 2 | 019709 | 23国债16 | 16,000 | 1,624,984.11 | 2.38 |
| 3 | 113685 | N升24转 | 130 | 13,000.97 | 0.02 |

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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6万元。

渝农商行（代码：601077.SH）为本基金前十大持仓证券。2023年11月9日，据重庆市江北区市场监督管理局发布的行政处罚信息显示，重庆农村商业银行股份有限公司因涉嫌使用不合格消毒餐碗的行为，重庆市江北区市场监督管理局责令公司改正违法行为，并作出警告处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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 | 9,059.62 |
| 2 | 应收清算款 | 87.12 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 20,603.28 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 29,750.02 |

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 | 000540 | *ST中天 | - | 0.00 | 摘牌 |

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 |
| 4,938 | 10,909.24 | 22,024,800.75 | 40.89% | 31,845,036.95 | 59.11% |

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 | 117,481.77 | 0.22% |

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、基金投资和研发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 | 25,558,786.18 |
| 本报告期基金总申购份额 | 31,782,227.44 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 3,471,175.92 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 53,869,837.70 |

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

2024年1月24日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，2024年1月5日新任公司公募基金事业部总经理贾鸣，原公司公募基金事业部总经理蔡红标因工作安排转任公司风险管理部总经理。

2024年4月13日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，2024年4月8日新任公司总裁黄本尧。

2024年6月20日，本基金管理人发布了《中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，2024年6月14日公司总裁黄本尧因工作调整离任。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员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 | 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 | |
| | | | | | | |

| | 量 | | | | | |
|------|---|---------------|--------|-----------|--------|---|
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | 18,439,742.00 | 34.53% | 13,753.92 | 34.53% | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 2 | 34,964,115.18 | 65.47% | 26,079.40 | 65.47% | - |

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下：

(1)基本情况：包括但不限于资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；主要股东实力强大；具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合进行证券交易的需要，并能为投资组合提供全面的信息服务；

(2)公司治理：公司治理完善，股东会、董事会、监事会及管理层权责明确，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；

(3)研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能在符合相关法规及执业规范的前提下，根据公司的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强风险意识和风险测算能力；

2、基金交易单元的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无新增或退租的交易单元。

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 |
| 长江证券 | 100,017.00 | 4.16% | 1,600,000.00 | 5.74% | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 2,302,777.33 | 95.84% | 26,260,000.00 | 94.26% | - | - | - | - |

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 | 关于旗下基金2023年4季度报告提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-19 |
| 2 | 人保中证500指数型证券投资基金2023年第4季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-19 |
| 3 | 中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-24 |
| 4 | 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 | 2024-02-01 |
| 5 | 关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-03-15 |

| | | | |
|----|-----------------------------------|--------------|------------|
| | 的提示性公告 | | |
| 6 | 人保中证500指数型证券投资基金招募说明书更新(2024年第1号) | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-03-15 |
| 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 | 2024-03-15 |
| 8 | 公司旗下部分基金2023年年度报告提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-03-30 |
| 9 | 人保中证500指数型证券投资基金2023年年度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-03-30 |
| 10 | 中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-04-13 |
| 11 | 公司旗下基金2024年1季度报告提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-04-19 |
| 12 | 人保中证500指数型证券投资基金2024年第1季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-04-19 |
| 13 | 中国人保资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-06-20 |
| 14 | 关于旗下部分基金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 | 2024-06-21 |
| 15 | 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 | 2024-06-21 |

§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 | 20240517-20240630 | - | 22,024,800.75 | - | 22,024,800.75 | 40.89% |
|----|---|-------------------|---|---------------|---|---------------|--------|

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

根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本基金自2024年6月28日起下调股票交易佣金费率。

§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规定报刊上披露的各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

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

基金托管人地址：中国（上海）长宁区仙霞路18号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司
二〇二四年八月三十一日