

# 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 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。本半年度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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2         |
| 1.2 目录 .....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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 .....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | <b>8</b>  |
| 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 .....                | 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>12</b> |
| 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....     | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 12        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 15        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                       | <b>33</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 33        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 34        |
| 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 .....       | 35        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 37        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 41        |
| 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 .....      | 41        |
| 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 .....   | 41        |
| 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 .....   | 42        |

|  |           |
|--|-----------|
| 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 ..... | 42        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....          | 42        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 42        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 42        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 43        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 43        |
| 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 .....   | 43        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                | 44        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>44</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 44        |
| 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 .....   | 44        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 45        |
| 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 .....      | 45        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 45        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 47        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>48</b> |
| 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 ..... | 48        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 48        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 48        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 48        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 太平灵活配置             |
| 基金主代码      | 000986             |
| 交易代码       | 000986             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式、发起式         |
| 基金合同生效日    | 2015 年 2 月 10 日    |
| 基金管理人      | 太平基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 兴业银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 2,136,730,412.38 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过优化资产配置和灵活运用多种投资策略，寻找推动经济增长的内在动力，精选具有较高成长性和投资价值的金融工具，在充分控制投资风险的基础上，力争实现持续稳定的投资回报。  |
| 投资策略 | <p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金采用自上而下的多因素分析方法进行宏观策略研究，对宏观经济方面重大问题、突发事件、重大政策进行及时研究与评估，对影响证券市场的相关因素（政策、资金、利率走向、行业比较、上市公司盈利增长预期、估值水平、市场心理等）进行综合考量，分析和预测证券市场走势和行业热点，预测权益类资产和固定收益类资产的风险收益特征，确定中长期的资产配置方案。在公司投资决策委员会的统一指导下进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、股指期货等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险并提高收益。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>本基金采用灵活的股票投资策略，充分挖掘中国经济结构调整和产业升级衍伸的投资机会，关注具有持续高成长性的行业和上市公司，以分享经济增长带来的投资回报。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>本基金债券投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略等。</p> <p>(四) 股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货投资。本基金通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，对股指期货合约进行估值定价，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。</p> <p>(五) 权证投资策略</p> <p>本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | 债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。<br>本基金的权证投资，是在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，投资于合理内在价值的权证品种。 |
| 业绩比较基准 | 1 年期银行定期存款利率（税后）+2%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。   |

## 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      | 太平基金管理有限公司                          | 兴业银行股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名                                  | 王刚                          |
|         | 联系电话                                | 021-38556787                |
|         | 电子邮箱                                | wanggang@taipingfund.com.cn |
| 客户服务电话  | 021-61560999                        | 95561                       |
| 传真      | 021-38556677                        | 021-62159217                |
| 注册地址    | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室           | 福州市湖东路 154 号                |
| 办公地址    | 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室 | 上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼        |
| 邮政编码    | 200120                              | 200041                      |
| 法定代表人   | 汤海涛                                 | 高建平                         |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                     |
|----------------------|-------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《上海证券报》                             |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.taipingfund.com.cn              |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                                |
|--------|------------|-------------------------------------|
| 注册登记机构 | 太平基金管理有限公司 | 上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室 |

## § 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(2019 年 1 月 1 日-2019 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 148,038,111.55                      |
| 本期利润          | 145,459,929.43                      |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0681                              |

|                      |                         |
|----------------------|-------------------------|
| 本期加权平均净值利润率          | 9.99%                   |
| 本期基金份额净值增长率          | 11.00%                  |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2019年6月30日)</b> |
| 期末可供分配利润             | -670,233,085.82         |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.3137                 |
| 期末基金资产净值             | 1,466,497,326.56        |
| 期末基金份额净值             | 0.686                   |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末(2019年6月30日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | -31.40%                 |

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

2、期末可供分配利润,采用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(为期末余额,不是当期发生数)。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

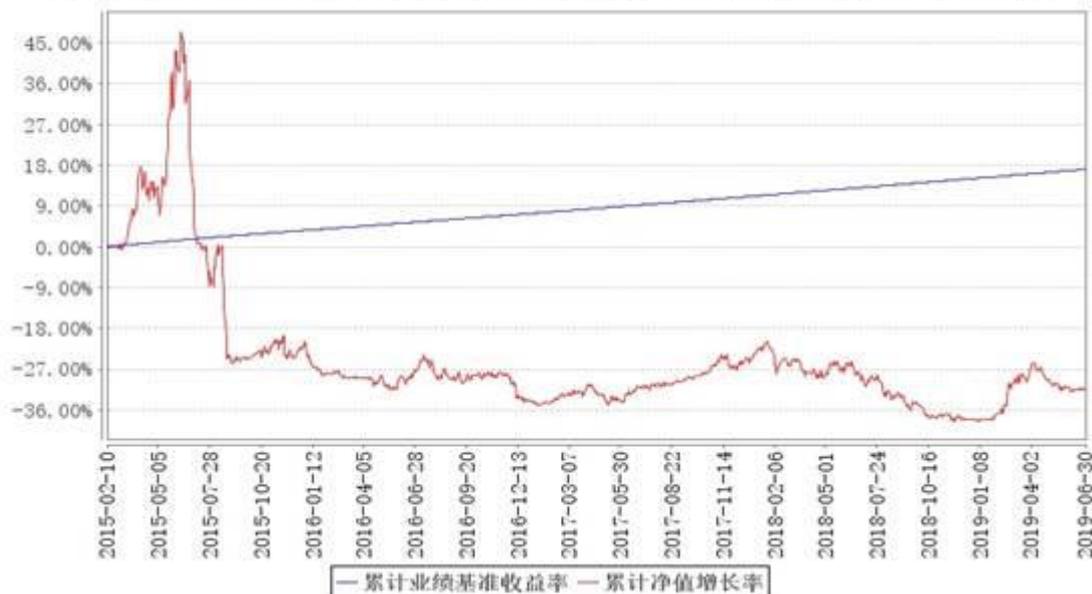
## 3.2 基金净值表现

### 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      | -0.72%   | 0.31%       | 0.29%      | 0.01%            | -1.01%  | 0.30% |
| 过去三个月      | -3.92%   | 0.62%       | 0.88%      | 0.01%            | -4.80%  | 0.61% |
| 过去六个月      | 11.00%   | 0.84%       | 1.75%      | 0.01%            | 9.25%   | 0.83% |
| 过去一年       | -4.46%   | 0.74%       | 3.56%      | 0.01%            | -8.02%  | 0.73% |
| 过去三年       | -5.64%   | 0.72%       | 11.07%     | 0.01%            | -16.71% | 0.71% |
| 自基金合同生效起至今 | -31.40%  | 1.08%       | 17.16%     | 0.01%            | -48.56% | 1.07% |

### 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

太平灵活配置累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2015 年 2 月 10 日生效。按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，截至 2015 年 8 月 10 日，本基金已完成建仓，基金的各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立。目前公司注册资本为人民币 4 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 83%，中原证券股份有限公司的出资占注册资本的 8.5%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 8.5%。

目前公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等，在投资管理、策略设计、产品设计、客户服务等方面配置了专业团队及集中了优势资源，力求为客户创造长期持续稳健的回报。截至本报告期末，公司共管理 7 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金、太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金、太平恒利纯债债券型证券投资基金、太平睿盈混合型证券投资基金、

太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金。

**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）<br>期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|----------------------------|---------------------|------|--------|--|
|     |                            | 任职日期                | 离任日期 |        |  |
| 林开盛 | 本基金的基金经理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理 | 2017 年 5 月 9 日      |      | 9 年    | 上海财经大学金融学专业证券投资方向硕士。具有证券投资基金从业资格。2009 年 7 月至 2016 年 4 月在申银万国证券研究所任首席分析师，精通化工行业分析。2016 年 4 月加入本公司任研究发展部负责人，从事投资研究相关工作。2017 年 5 月 9 日起担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理；2019 年 3 月 25 日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。中国国籍。 |
| 徐磊  | 本基金的基金经理                   | 2019 年 1 月 29 日     |      | 8 年    | 英国埃克塞特大学金融学博士，经济学硕士，南开大学金融学本科。CFA、FRM。8 年海内外证券基金行业从业经验。其中海外投资经验 2 年。2016 年 4 月加入本公司，现任量化投资部负责人。曾在花旗私人银行（欧非中东总部，伦敦）和 Kleinwort Benson 私人银行（伦敦）从事全球资产配置的数量研究工作，涵盖美国，欧洲，亚洲等市场，包括香港的股票                     |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 市场，回国后先后在中原英石基金和嘉合基金任量化研究员和投资经理。2019 年 1 月 29 日起担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍。 |
|--|--|--|--|--|--|

注:1、基金经理的任职日期和离职离任日期一般情况下指为公司对外公告之日；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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，未发生违法违规或未履行基金合同的情形。

#### 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本基金管理人管理的所有投资组合参与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的 5% 的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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

2019 年上半年 A 股市场可大致分为两个阶段：阶段 1 为年初到 4 月中上旬，市场持续走高，投资热点涌现；阶段 2 为 4 月中下旬到 6 月底，随着中美关系不确定性上升，市场整体呈现冲高回落后不断震荡的走势，投资热点退潮。本基金在报告期内，前期积极地参与了金融、农业、化工等板块，后期逢高兑现了部分收益，领先于市场显著降低了股票仓位，相对较好地控制了回撤风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 11.00%，同期业绩比较基准收益率为 1.75%。

## 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 2019 年下半年，预期中美贸易谈判有望逐步取得进展，国内宏观经济增速也有望在政策托底下逐季企稳，随着科创板的推出和海外流入资金的扩容，预期三季度可能会是市场信心显著修复的时间窗口，本基金计划增大对 TMT 板块的关注，同时关注景气度向好的化工和农业板块中的细分领域，力争给投资者满意的回报。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金资产的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员由主席负责，成员包括稽核风控部门负责人、量化投资部门负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关约定，本基金本报告期内未进行利润分配，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

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况。

### § 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 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：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 405,788,855.40         | 642,125,349.91           |
| 结算备付金      |         | 4,337,059.95           | 12,492,226.46            |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 存出保证金           |            | 2,357,546.69              | 784,439.43                  |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 743,053,659.86            | 157,971,728.69              |
| 其中：股票投资         |            | 569,998,659.86            | 67,227,728.69               |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | 173,055,000.00            | 90,744,000.00               |
| 资产支持证券投资        |            | -                         | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 400,000,000.00            | 500,001,270.00              |
| 应收证券清算款         |            | -                         | 9,224,816.32                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 5,353,722.63              | 2,125,482.08                |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 199.70                    | 199.70                      |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 1,560,891,044.23          | 1,324,725,512.59            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2018年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                           |                             |
| 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       |            | -                         | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 88,748,543.78             | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                         | 857.83                      |
| 应付管理人报酬         |            | 1,804,652.21              | 1,688,537.51                |
| 应付托管费           |            | 300,775.36                | 281,422.90                  |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 3,227,449.00              | 1,313,002.62                |
| 应交税费            |            | 3,820.18                  | 3,947.51                    |
| 应付利息            |            | -                         | -                           |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 308,477.14                | 309,301.61                  |
| 负债合计            |            | 94,393,717.67             | 3,597,069.98                |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 2,136,730,412.38          | 2,136,859,144.79            |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | -670,233,085.82           | -815,730,702.18             |
| 所有者权益合计         |            | 1,466,497,326.56          | 1,321,128,442.61            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,560,891,044.23          | 1,324,725,512.59            |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.686 元，基金份额总额 2,136,730,412.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2019 年 1 月 1 日 至 2019<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| 一、收入                   |            | 171,801,067.11                            | -54,849,494.11                                 |
| 1. 利息收入                |            | 11,373,747.50                             | 11,228,488.13                                  |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 4,377,422.04                              | 2,740,736.79                                   |
| 债券利息收入                 |            | 4,890,954.27                              | 2,764,461.97                                   |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入             |            | 2,105,371.19                              | 5,723,289.37                                   |
| 其他利息收入                 |            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 163,004,759.28                            | -31,079,015.66                                 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 158,402,528.01                            | -36,107,808.18                                 |
| 基金投资收益                 |            | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | 106,230.70                                | -2,659,867.20                                  |
| 资产支持证券投资收益             |            | -   | -  |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14   | -   | -  |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15   | -   | -  |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | 4,496,000.57                              | 7,688,659.72                                   |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.17   | -2,578,182.12                             | -35,000,835.22                                 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)     |            | -   | -  |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)     | 6.4.7.18   | 742.45                                    | 1,868.64                                       |
| 减：二、费用                 |            | 26,341,137.68                             | 16,209,796.12                                  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 10,803,859.45                             | 11,779,912.69                                  |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,800,643.22                              | 1,963,318.80                                   |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -   | -  |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 13,614,364.35                             | 2,343,821.77                                   |
| 5. 利息支出                |            | -   | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -   | -  |
| 6. 税金及附加               |            | 2,284.06                                  | 2,491.71                                       |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 119,986.60                                | 120,251.15                                     |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)    |            | 145,459,929.43                            | -71,059,290.23                                 |

|                   |  |                |                |
|-------------------|--|----------------|----------------|
| 减：所得税费用           |  | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 145,459,929.43 | -71,059,290.23 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日      |                 |                  |
|--|---|-----------------|------------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 2,136,859,144.79                            | -815,730,702.18 | 1,321,128,442.61 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 145,459,929.43  | 145,459,929.43   |
| 三、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）      | -128,732.41                                 | 37,686.93       | -91,045.48       |
| 其中：1. 基金申购款                            | 261,565.03                                  | -77,912.76      | 183,652.27       |
| 2. 基金赎回款                               | -390,297.44                                 | 115,599.69      | -274,697.75      |
| 四、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） | -   | -               | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,136,730,412.38                            | -670,233,085.82 | 1,466,497,326.56 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 |                 |                  |
|  | 实收基金  | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 2,138,644,680.61                            | -532,401,011.70 | 1,606,243,668.91 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | -71,059,290.23  | -71,059,290.23   |
| 三、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）      | -1,805,912.49                               | 486,195.66      | -1,319,716.83    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 264,039.94                                  | -62,014.42      | 202,025.52       |

|  |                  |                 |                  |
|--|------------------|-----------------|------------------|
| 2. 基金赎回款                               | -2,069,952.43    | 548,210.08      | -1,521,742.35    |
| 四、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） | -                | -               | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,136,838,768.12 | -602,974,106.27 | 1,533,864,661.85 |

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：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>邱宏斌</u> | <u>宋卫华</u> | <u>孙波</u> |
| 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

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金(原名为中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]1392号《关于准予中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由原中原英石基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币13,555,569.64元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第115号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于2015年2月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为13,557,227.44份基金份额,其中认购资金利息折合1,657.80份基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司(原中原英石基金管理有限公司),基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据本基金管理人于2016年9月29日发布的《太平基金管理有限公司关于旗下中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金更名的公告》,中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金自2016年9月29日起更名为太平灵活配置混合型发起式证券投资基金。

本基金为发起式基金。基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员认购金额不低于1,000万元,认购的基金份额持有期限不低于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金

合同》的有关规定，本基金的投资对象为良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、可转换债券、银行存款和债券等资产，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相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，固定收益类资产投资占基金资产的比例为 5%-100%，扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券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。本基金的业绩比较基准为：1 年期银行定期存款利率（税后）+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人太平基金管理有限公司于 2019 年 8 月 22 日批准报出。

#### 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间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 差错更正的说明

本基金本报告期末发生重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的

补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 405,788,855.40         |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月及以上   | -                      |
| 其他存款           | -                      |

|    |                |
|----|----------------|
| 合计 | 405,788,855.40 |
|----|----------------|

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年6月30日 |                |                |
|---------------|-------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 573,301,668.57    | 569,998,659.86 | -3,303,008.71  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场             | -              | -              |
|               | 银行间市场             | 174,177,667.26 | 173,055,000.00 |
|               | 合计                | 174,177,667.26 | 173,055,000.00 |
| 资产支持证券        | -                 | -              | -              |
| 基金            | -                 | -              | -              |
| 其他            | -                 | -              | -              |
| 合计            | 747,479,335.83    | 743,053,659.86 | -4,425,675.97  |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2019年6月30日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 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<br>2019年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 400,000,000.00    | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 400,000,000.00    | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2019年6月30日）本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-----------|-------------------|
| 应收活期存款利息  | 253,248.08        |
| 应收定期存款利息  | -                 |
| 应收其他存款利息  | -                 |
| 应收结算备付金利息 | 1,951.70          |

|            |              |
|------------|--------------|
| 应收债券利息     | 5,097,461.91 |
| 应收资产支持证券利息 | -            |
| 应收买入返售证券利息 | -            |
| 应收申购款利息    | 0.04         |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -            |
| 其他         | 1,060.90     |
| 合计         | 5,353,722.63 |

#### 6.4.7.6 其他资产

本期末（2019年6月30日）本基金未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 3,227,449.00      |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 3,227,449.00      |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提_账户维护费    | 9,300.00          |
| 预提审计费       | 49,588.57         |
| 预提信息披露费     | 249,588.57        |
| 合计          | 308,477.14        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                  |
|---------------|----------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额             |
| 上年度末          | 2,136,859,144.79           | 2,136,859,144.79 |
| 本期申购          | 261,565.03                 | 261,565.03       |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -390,297.44                | -390,297.44      |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -                |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                          | -                |
| 本期申购          | -                          | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                          | -                |
| 本期末           | 2,136,730,412.38           | 2,136,730,412.38 |

#### 6.4.7.10 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           | -806,159,694.24 | -9,571,007.94  | -815,730,702.18 |
| 本期利润           | 148,038,111.55  | -2,578,182.12  | 145,459,929.43  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 39,654.97       | -1,968.04      | 37,686.93       |
| 其中：基金申购款       | -80,133.01      | 2,220.25       | -77,912.76      |
| 基金赎回款          | 119,787.98      | -4,188.29      | 115,599.69      |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | -658,081,927.72 | -12,151,158.10 | -670,233,085.82 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 4,266,420.64               |
| 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 | 98,066.01                  |
| 其他        | 12,935.39                  |
| 合计        | 4,377,422.04               |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 5,166,466,956.81           |
| 减：卖出股票成本总额 | 5,008,064,428.80           |
| 买卖股票差价收入   | 158,402,528.01             |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 346,571,891.89             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 343,876,100.00             |
| 减：应收利息总额                | 2,589,561.19               |
| 买卖债券差价收入                | 106,230.70                 |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期                               |
|-------------|----------------------------------|
|             | 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 4,496,000.57                     |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                |
| 合计          | 4,496,000.57                     |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期                               |
|----------------------------|----------------------------------|
|                            | 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产                 | -2,578,182.12                    |
| 股票投资                       | -1,412,542.12                    |
| 债券投资                       | -1,165,640.00                    |
| 资产支持证券投资                   | -                                |
| 基金投资                       | -                                |
| 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<br>税 | -                                |
| 合计                         | -2,578,182.12                    |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                               |
|---------|----------------------------------|
|         | 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 742.45                           |
| 合计      | 742.45                           |

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                               |
|-----------|----------------------------------|
|           | 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 |
| 交易所市场交易费用 | 13,610,764.35                    |
| 银行间市场交易费用 | 3,600.00                         |
| 合计        | 13,614,364.35                    |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                               |
|---------|----------------------------------|
|         | 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日 |
| 审计费用    | 49,588.57                        |
| 信息披露费   | 49,588.57                        |
| 银行划款手续费 | 2,209.46                         |

|           |            |
|-----------|------------|
| 上市年费      | -          |
| 债券托管账户维护费 | 18,600.00  |
| 指数使用费     | -          |
| 红利手续费     | -          |
| 其他        | -          |
| 合计        | 119,986.60 |

#### 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，本基金无需要说明的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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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           |
|--------------------|-------------------|
| 太平基金管理有限公司（“太平基金”） | 基金管理人、基金销售机构、登记机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人             |
| 太平资产管理有限公司（“太平资管”） | 基金管理人的股东          |
| 中原证券股份有限公司（“中原证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构   |
| 安石投资管理有限公司（“安石投资”） | 基金管理人的股东          |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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，未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未发生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                   | 上年度可比期间              |
|-----------------|----------------------|----------------------|
|                 | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 10,803,859.45        | 11,779,912.69        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,414.17             | 1,930.74             |

注：支付基金管理人太平基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.50%÷当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2019年1月1日至2019年6月30日 | 2018年1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,800,643.22         | 1,963,318.80         |

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%÷当年天数。

### 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

本报告期内及上年度可比期间，本基金未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 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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                  | 上年度可比期间           |
|----|---------------------|-------------------|
|    | 2019年1月1日至2019年6月30 | 2018年1月1日至2018年6月 |

|                   | 日             | 30 日          |
|-------------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日(-)持有的基金份额 | 10,001,375.14 | 10,001,375.14 |
| 期初持有的基金份额         | 10,001,375.14 | 10,001,375.14 |
| 期间申购/买入总份额        | -             | -             |
| 期间因拆分变动份额         | -             | -             |
| 减:期间赎回/卖出总份额      | -             | -             |
| 期末持有的基金份额         | 10,001,375.14 | 10,001,375.14 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.47%         | 0.47%         |

注:本基金管理人按照本基金基金合同、招募说明书的约定费率进行认购、申购和赎回,不享有比其他投资人更优惠的费率。

#### 6.4.10.4.2 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

报告期末及上年度末,其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |              |
|------------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|            | 期末余额                       | 当期利息收入       | 期末余额                            | 当期利息收入       |
| 兴业银行股份有限公司 | 405,788,855.40             | 4,266,420.64 | 669,712,546.34                  | 2,672,041.20 |

注:本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管,按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间,本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间,本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内,本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别:股票 |    |    |     |     |    |     |    |    |      |    |
|----------------------|----|----|-----|-----|----|-----|----|----|------|----|
| 证券                   | 证券 | 成功 | 可流通 | 流通受 | 认购 | 期末估 | 数量 | 期末 | 期末估值 | 备注 |

| 代码     | 名称       | 认购日        | 日          | 限类型      | 价格   | 值单价  | (单<br>位:股) | 成本总额      | 总额        |          |
|--------|----------|------------|------------|----------|------|------|------------|-----------|-----------|----------|
| 601236 | 红塔<br>证券 | 2019-06-26 | 2019-07-05 | 新股认<br>购 | 3.46 | 3.46 | 9,789      | 33,869.94 | 33,869.94 | 网下申<br>购 |

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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

本基金属于混合型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货、权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构,并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调

和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

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的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

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2019年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为2.08%(2018年12月31日：2.31%)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.002%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 1,554,162,567.65 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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；按照穿

透原则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。

#### 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，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

利率风险是指金融工具的公允价值或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定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年6<br>月30日 | 1个月以内          | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计             |
|-----------------------|----------------|-------|--------|------|------|-----|----------------|
| 资产                    |                |       |        |      |      |     |                |
| 银行存款                  | 405,788,855.40 | -     | -      | -    | -    | -   | 405,788,855.40 |
| 结算备付金                 | 4,337,059.95   | -     | -      | -    | -    | -   | 4,337,059.95   |
| 存出保证金                 | 2,357,546.69   | -     | -      | -    | -    | -   | 2,357,546.69   |

|                       |                |               |               |               |       |                |                  |
|-----------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|-------|----------------|------------------|
| 交易性金融资产               | 60,018,000.00  | 30,459,000.00 | 20,142,000.00 | 62,436,000.00 |       | 569,998,659.86 | 743,053,659.86   |
| 买入返售金融资产              | 400,000,000.00 | -             | -             | -             | -     | -              | 400,000,000.00   |
| 应收利息                  | -              | -             | -             | -             | -     | -5,353,722.63  | 5,353,722.63     |
| 应收申购款                 | -              | -             | -             | -             | -     | 199.70         | 199.70           |
| 资产总计                  | 872,501,462.04 | 30,459,000.00 | 20,142,000.00 | 62,436,000.00 |       | 575,352,582.19 | 1,560,891,044.23 |
| 负债                    |                |               |               |               |       |                |                  |
| 应付管理人报酬               | -              | -             | -             | -             | -     | -1,804,652.21  | 1,804,652.21     |
| 应付托管费                 | -              | -             | -             | -             | -     | 300,775.36     | 300,775.36       |
| 应付证券清算款               | -              | -             | -             | -             | -     | 88,748,543.78  | 88,748,543.78    |
| 应付交易费用                | -              | -             | -             | -             | -     | -3,227,449.00  | 3,227,449.00     |
| 应付税费                  | -              | -             | -             | -             | -     | 3,820.18       | 3,820.18         |
| 其他负债                  | -              | -             | -             | -             | -     | 308,477.14     | 308,477.14       |
| 负债总计                  | -              | -             | -             | -             | -     | 94,393,717.67  | 94,393,717.67    |
| 利率敏感度缺口               | 872,501,462.04 | 30,459,000.00 | 20,142,000.00 | 62,436,000.00 |       | 480,958,864.52 | 1,466,497,326.56 |
| 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | 1 个月以内         | 1-3 个月        | 3 个月-1 年      | 1-5 年         | 5 年以上 | 不计息            | 合计               |
| 资产                    |                |               |               |               |       |                |                  |
| 银行存款                  | 642,125,349.91 | -             | -             | -             | -     | -              | 642,125,349.91   |
| 结算备付金                 | 12,492,226.46  | -             | -             | -             | -     | -              | 12,492,226.46    |
| 存出保证金                 | 784,439.43     | -             | -             | -             | -     | -              | 784,439.43       |
| 交易性金融资产               | -              | -             | 90,744,000.00 | -             | -     | 67,227,728.69  | 157,971,728.69   |
| 买入返售金融资产              | 500,001,270.00 | -             | -             | -             | -     | -              | 500,001,270.00   |
| 应收利息                  | -              | -             | -             | -             | -     | -2,125,482.08  | 2,125,482.08     |
| 应收申购                  | -              | -             | -             | -             | -     | 199.70         | 199.70           |

|         |                  |   |               |   |   |               |                  |
|---------|------------------|---|---------------|---|---|---------------|------------------|
| 款       |                  |   |               |   |   |               |                  |
| 应收证券清算款 | -                | - | -             | - | - | -9,224,816.32 | 9,224,816.32     |
| 资产总计    | 1,155,403,285.80 | - | 90,744,000.00 | - | - | 78,578,226.79 | 1,324,725,512.59 |
| 负债      |                  |   |               |   |   |               |                  |
| 应付赎回款   | -                | - | -             | - | - | 857.83        | 857.83           |
| 应付管理人报酬 | -                | - | -             | - | - | -1,688,537.51 | 1,688,537.51     |
| 应付托管费   | -                | - | -             | - | - | 281,422.90    | 281,422.90       |
| 应付交易费用  | -                | - | -             | - | - | -1,313,002.62 | 1,313,002.62     |
| 应付税费    | -                | - | -             | - | - | 3,947.51      | 3,947.51         |
| 其他负债    | -                | - | -             | - | - | 309,301.61    | 309,301.61       |
| 负债总计    | -                | - | -             | - | - | -3,597,069.98 | 3,597,069.98     |
| 利率敏感度缺口 | 1,155,403,285.80 | - | 90,744,000.00 | - | - | 74,981,156.81 | 1,321,128,442.61 |

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,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

于 2019 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 11.80%(2018 年 12 月 31 日: 6.87%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日: 同)。

#### 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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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<br>2019年6月30日 |               | 上年度末<br>2018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 | 569,998,659.86    | 38.87         | 67,227,728.69       | 5.09          |
| 合计           | 569,998,659.86    | 38.87         | 67,227,728.69       | 5.09          |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|-------------------------|-----------------------------|-------------------|
| 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（2019年6月30日）             | 上年度末（2018年12月31日） |
|    | 沪深 300 指数上升 5%          | 29,929,064.46               | 3,097,876.16      |
|    | 沪深 300 指数下降 5%          | -29,929,064.46              | -3,097,876.16     |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 569,964,789.92 元，属于第二层次的余额为 173,088,869.94 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 53,409,959.50 元，第二层次 104,561,769.19 元，无第三层次)。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 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(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值外，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              | 569,998,659.86   | 36.52  |
|   | 其中：股票             | 569,998,659.86   | 36.52  |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 173,055,000.00   | 11.09  |
|   | 其中：债券             | 173,055,000.00   | 11.09  |
|   | 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          | 400,000,000.00   | 25.63  |
|   | 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      | 410,125,915.35   | 26.28  |
| 8 | 其他各项资产            | 7,711,469.02     | 0.49   |
| 9 | 合计                | 1,560,891,044.23 | 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              | 1,784,773.25   | 0.12         |
| C  | 制造业              | 431,110,007.21 | 29.40        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,703,200.00   | 0.12         |
| E  | 建筑业              | 32,391,017.20  | 2.21         |
| F  | 批发和零售业           | 3,549,670.80   | 0.24         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 13,851,914.00  | 0.94         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 31,645,534.36  | 2.16         |
| J  | 金融业              | 14,157,533.94  | 0.97         |
| K  | 房地产业             | 5,157,097.00   | 0.35         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 34,502,130.10  | 2.35         |
| 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        | 145,782.00     | 0.01         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 569,998,659.86 | 38.87        |

### 7.2.2 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投资股票。

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

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  | 600352 | 浙江龙盛 | 2,563,796.00 | 40,431,062.92 | 2.76         |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 569,908.00   | 31,344,940.00 | 2.14         |
| 3  | 002384 | 东山精密 | 2,130,000.00 | 31,034,100.00 | 2.12         |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 900,000.00   | 30,069,000.00 | 2.05         |
| 5  | 600284 | 浦东建设 | 3,799,906.00 | 29,259,276.20 | 2.00         |
| 6  | 002035 | 华帝股份 | 2,398,679.00 | 29,215,910.22 | 1.99         |
| 7  | 601888 | 中国国旅 | 315,674.00   | 27,984,500.10 | 1.91         |
| 8  | 600216 | 浙江医药 | 2,199,847.00 | 22,526,433.28 | 1.54         |
| 9  | 002353 | 杰瑞股份 | 939,917.00   | 21,712,082.70 | 1.48         |
| 10 | 300601 | 康泰生物 | 399,940.00   | 20,996,850.00 | 1.43         |
| 11 | 601100 | 恒立液压 | 650,000.00   | 20,397,000.00 | 1.39         |
| 12 | 002230 | 科大讯飞 | 599,950.00   | 19,942,338.00 | 1.36         |
| 13 | 002001 | 新和成  | 999,850.00   | 19,287,106.50 | 1.32         |
| 14 | 601012 | 隆基股份 | 799,956.00   | 18,486,983.16 | 1.26         |
| 15 | 300630 | 普利制药 | 319,925.00   | 18,434,078.50 | 1.26         |
| 16 | 600438 | 通威股份 | 1,300,000.00 | 18,278,000.00 | 1.25         |
| 17 | 600809 | 山西汾酒 | 200,000.00   | 13,810,000.00 | 0.94         |
| 18 | 002352 | 顺丰控股 | 390,000.00   | 13,244,400.00 | 0.90         |
| 19 | 603517 | 绝味食品 | 317,340.00   | 12,347,699.40 | 0.84         |
| 20 | 000596 | 古井贡酒 | 100,000.00   | 11,851,000.00 | 0.81         |
| 21 | 000858 | 五粮液  | 99,995.00    | 11,794,410.25 | 0.80         |
| 22 | 600588 | 用友网络 | 399,920.00   | 10,749,849.60 | 0.73         |
| 23 | 600160 | 巨化股份 | 1,400,000.00 | 9,954,000.00  | 0.68         |
| 24 | 300122 | 智飞生物 | 202,711.00   | 8,736,844.10  | 0.60         |
| 25 | 600872 | 中炬高新 | 150,000.00   | 6,424,500.00  | 0.44         |
| 26 | 300662 | 科锐国际 | 178,100.00   | 6,308,302.00  | 0.43         |
| 27 | 300357 | 我武生物 | 149,920.00   | 5,085,286.40  | 0.35         |
| 28 | 300136 | 信维通信 | 200,000.00   | 4,890,000.00  | 0.33         |
| 29 | 002648 | 卫星石化 | 300,000.00   | 4,464,000.00  | 0.30         |
| 30 | 601318 | 中国平安 | 39,100.00    | 3,464,651.00  | 0.24         |
| 31 | 603899 | 晨光文具 | 70,200.00    | 3,086,694.00  | 0.21         |
| 32 | 002557 | 洽洽食品 | 115,600.00   | 2,918,900.00  | 0.20         |
| 33 | 601328 | 交通银行 | 298,800.00   | 1,828,656.00  | 0.12         |
| 34 | 600036 | 招商银行 | 47,700.00    | 1,716,246.00  | 0.12         |
| 35 | 601186 | 中国铁建 | 125,900.00   | 1,252,705.00  | 0.09         |
| 36 | 000402 | 金融街  | 157,500.00   | 1,234,800.00  | 0.08         |

|    |        |       |            |              |      |
|----|--------|-------|------------|--------------|------|
| 37 | 002146 | 荣盛发展  | 127,000.00 | 1,192,530.00 | 0.08 |
| 38 | 600030 | 中信证券  | 47,800.00  | 1,138,118.00 | 0.08 |
| 39 | 600837 | 海通证券  | 78,700.00  | 1,116,753.00 | 0.08 |
| 40 | 000709 | 河钢股份  | 367,900.00 | 1,100,021.00 | 0.08 |
| 41 | 600340 | 华夏幸福  | 33,300.00  | 1,084,581.00 | 0.07 |
| 42 | 600585 | 海螺水泥  | 25,500.00  | 1,058,250.00 | 0.07 |
| 43 | 601688 | 华泰证券  | 47,000.00  | 1,049,040.00 | 0.07 |
| 44 | 601607 | 上海医药  | 57,400.00  | 1,041,810.00 | 0.07 |
| 45 | 600153 | 建发股份  | 116,600.00 | 1,035,408.00 | 0.07 |
| 46 | 000425 | 徐工机械  | 228,400.00 | 1,018,664.00 | 0.07 |
| 47 | 000413 | 东旭光电  | 179,800.00 | 924,172.00   | 0.06 |
| 48 | 000568 | 泸州老窖  | 11,200.00  | 905,296.00   | 0.06 |
| 49 | 600016 | 民生银行  | 136,300.00 | 865,505.00   | 0.06 |
| 50 | 600023 | 浙能电力  | 193,400.00 | 854,828.00   | 0.06 |
| 51 | 600170 | 上海建工  | 212,800.00 | 800,128.00   | 0.05 |
| 52 | 000898 | 鞍钢股份  | 210,210.00 | 796,695.90   | 0.05 |
| 53 | 600297 | 广汇汽车  | 158,600.00 | 707,356.00   | 0.05 |
| 54 | 000069 | 华侨城 A | 101,300.00 | 704,035.00   | 0.05 |
| 55 | 600177 | 雅戈尔   | 106,620.00 | 677,037.00   | 0.05 |
| 56 | 000895 | 双汇发展  | 27,000.00  | 672,030.00   | 0.05 |
| 57 | 600188 | 兖州煤业  | 58,400.00  | 634,808.00   | 0.04 |
| 58 | 000333 | 美的集团  | 11,900.00  | 617,134.00   | 0.04 |
| 59 | 600522 | 中天科技  | 66,400.00  | 608,888.00   | 0.04 |
| 60 | 601668 | 中国建筑  | 101,200.00 | 581,900.00   | 0.04 |
| 61 | 600089 | 特变电工  | 77,000.00  | 558,250.00   | 0.04 |
| 62 | 002065 | 东华软件  | 78,700.00  | 550,113.00   | 0.04 |
| 63 | 600482 | 中国动力  | 23,100.00  | 545,622.00   | 0.04 |
| 64 | 002179 | 中航光电  | 15,800.00  | 528,668.00   | 0.04 |
| 65 | 000963 | 华东医药  | 19,080.00  | 495,316.80   | 0.03 |
| 66 | 000338 | 潍柴动力  | 38,500.00  | 473,165.00   | 0.03 |
| 67 | 603288 | 海天味业  | 4,500.00   | 472,500.00   | 0.03 |
| 68 | 000001 | 平安银行  | 33,600.00  | 463,008.00   | 0.03 |
| 69 | 002142 | 宁波银行  | 18,900.00  | 458,136.00   | 0.03 |
| 70 | 601998 | 中信银行  | 73,400.00  | 438,198.00   | 0.03 |
| 71 | 600015 | 华夏银行  | 56,200.00  | 432,740.00   | 0.03 |
| 72 | 600516 | 方大炭素  | 35,164.00  | 432,165.56   | 0.03 |
| 73 | 600886 | 国投电力  | 55,400.00  | 430,458.00   | 0.03 |
| 74 | 600000 | 浦发银行  | 36,400.00  | 425,152.00   | 0.03 |
| 75 | 601818 | 光大银行  | 110,000.00 | 419,100.00   | 0.03 |
| 76 | 002415 | 海康威视  | 13,200.00  | 364,056.00   | 0.02 |
| 77 | 600637 | 东方明珠  | 34,500.00  | 363,630.00   | 0.02 |
| 78 | 600968 | 海油发展  | 102,375.00 | 363,431.25   | 0.02 |

|     |        |      |            |            |      |
|-----|--------|------|------------|------------|------|
| 79  | 603160 | 汇顶科技 | 2,400.00   | 333,120.00 | 0.02 |
| 80  | 601225 | 陕西煤业 | 34,100.00  | 315,084.00 | 0.02 |
| 81  | 600018 | 上港集团 | 45,900.00  | 313,038.00 | 0.02 |
| 82  | 002493 | 荣盛石化 | 25,800.00  | 311,148.00 | 0.02 |
| 83  | 600390 | 五矿资本 | 32,700.00  | 308,361.00 | 0.02 |
| 84  | 601006 | 大秦铁路 | 36,400.00  | 294,476.00 | 0.02 |
| 85  | 600219 | 南山铝业 | 126,500.00 | 285,890.00 | 0.02 |
| 86  | 600028 | 中国石化 | 51,000.00  | 278,970.00 | 0.02 |
| 87  | 002024 | 苏宁易购 | 23,500.00  | 269,780.00 | 0.02 |
| 88  | 600271 | 航天信息 | 11,500.00  | 265,075.00 | 0.02 |
| 89  | 000656 | 金科股份 | 43,800.00  | 264,114.00 | 0.02 |
| 90  | 600104 | 上汽集团 | 10,100.00  | 257,550.00 | 0.02 |
| 91  | 600309 | 万华化学 | 5,200.00   | 222,508.00 | 0.02 |
| 92  | 000415 | 渤海租赁 | 53,400.00  | 209,328.00 | 0.01 |
| 93  | 601390 | 中国中铁 | 29,800.00  | 194,296.00 | 0.01 |
| 94  | 601898 | 中煤能源 | 40,100.00  | 192,480.00 | 0.01 |
| 95  | 002311 | 海大集团 | 6,200.00   | 191,580.00 | 0.01 |
| 96  | 601117 | 中国化学 | 31,600.00  | 190,232.00 | 0.01 |
| 97  | 601992 | 金隅集团 | 48,700.00  | 183,112.00 | 0.01 |
| 98  | 600025 | 华能水电 | 38,200.00  | 155,474.00 | 0.01 |
| 99  | 300144 | 宋城演艺 | 6,300.00   | 145,782.00 | 0.01 |
| 100 | 600688 | 上海石化 | 27,300.00  | 140,868.00 | 0.01 |
| 101 | 600900 | 长江电力 | 7,800.00   | 139,620.00 | 0.01 |
| 102 | 601877 | 正泰电器 | 5,500.00   | 126,995.00 | 0.01 |
| 103 | 600674 | 川投能源 | 13,800.00  | 122,820.00 | 0.01 |
| 104 | 601618 | 中国中冶 | 37,000.00  | 112,480.00 | 0.01 |
| 105 | 300782 | 卓胜微  | 743.00     | 80,927.56  | 0.01 |
| 106 | 601698 | 中国卫通 | 10,103.00  | 39,603.76  | 0.00 |
| 107 | 601236 | 红塔证券 | 9,789.00   | 33,869.94  | 0.00 |
| 108 | 300594 | 朗进科技 | 721.00     | 31,803.31  | 0.00 |
| 109 | 603867 | 新化股份 | 1,045.00   | 26,971.45  | 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  | 600352 | 浙江龙盛 | 151,001,142.87 | 11.43          |
| 2  | 002440 | 闰土股份 | 122,131,214.44 | 9.24           |
| 3  | 601688 | 华泰证券 | 97,639,440.12  | 7.39           |
| 4  | 600284 | 浦东建设 | 83,073,979.94  | 6.29           |
| 5  | 600160 | 巨化股份 | 73,187,743.20  | 5.54           |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 6  | 002714 | 牧原股份  | 72,368,899.92 | 5.48 |
| 7  | 002035 | 华帝股份  | 72,317,186.41 | 5.47 |
| 8  | 300498 | 温氏股份  | 71,035,711.76 | 5.38 |
| 9  | 300618 | 寒锐钴业  | 61,443,300.62 | 4.65 |
| 10 | 600547 | 山东黄金  | 58,424,504.00 | 4.42 |
| 11 | 002384 | 东山精密  | 56,407,841.80 | 4.27 |
| 12 | 600030 | 中信证券  | 54,983,277.96 | 4.16 |
| 13 | 601100 | 恒立液压  | 54,718,695.54 | 4.14 |
| 14 | 600016 | 民生银行  | 54,045,333.01 | 4.09 |
| 15 | 600887 | 伊利股份  | 53,624,827.20 | 4.06 |
| 16 | 601328 | 交通银行  | 52,740,115.57 | 3.99 |
| 17 | 600837 | 海通证券  | 50,654,318.17 | 3.83 |
| 18 | 600050 | 中国联通  | 50,400,869.50 | 3.81 |
| 19 | 300014 | 亿纬锂能  | 50,229,071.85 | 3.80 |
| 20 | 600742 | 一汽富维  | 49,532,267.93 | 3.75 |
| 21 | 300601 | 康泰生物  | 47,846,064.65 | 3.62 |
| 22 | 600028 | 中国石化  | 47,479,659.75 | 3.59 |
| 23 | 300316 | 晶盛机电  | 46,284,914.88 | 3.50 |
| 24 | 600216 | 浙江医药  | 45,725,983.35 | 3.46 |
| 25 | 002648 | 卫星石化  | 44,222,762.80 | 3.35 |
| 26 | 600498 | 烽火通信  | 43,321,796.24 | 3.28 |
| 27 | 000651 | 格力电器  | 43,283,457.00 | 3.28 |
| 28 | 601800 | 中国交建  | 42,037,991.47 | 3.18 |
| 29 | 601998 | 中信银行  | 41,150,727.00 | 3.11 |
| 30 | 000783 | 长江证券  | 41,132,035.74 | 3.11 |
| 31 | 002463 | 沪电股份  | 40,458,333.49 | 3.06 |
| 32 | 601933 | 永辉超市  | 39,783,210.00 | 3.01 |
| 33 | 601818 | 光大银行  | 39,721,002.90 | 3.01 |
| 34 | 002001 | 新 和 成 | 39,670,563.37 | 3.00 |
| 35 | 600000 | 浦发银行  | 39,583,456.12 | 3.00 |
| 36 | 601117 | 中国化学  | 39,533,105.45 | 2.99 |
| 37 | 601012 | 隆基股份  | 39,107,069.99 | 2.96 |
| 38 | 603799 | 华友钴业  | 38,058,515.16 | 2.88 |
| 39 | 002422 | 科伦药业  | 37,994,733.90 | 2.88 |
| 40 | 600259 | 广晟有色  | 37,621,601.63 | 2.85 |
| 41 | 601318 | 中国平安  | 37,448,411.82 | 2.83 |
| 42 | 600845 | 宝信软件  | 37,168,627.09 | 2.81 |
| 43 | 603899 | 晨光文具  | 36,853,492.00 | 2.79 |
| 44 | 600060 | 海信电器  | 35,979,006.24 | 2.72 |
| 45 | 603505 | 金石资源  | 35,357,863.00 | 2.68 |
| 46 | 600438 | 通威股份  | 34,499,585.00 | 2.61 |
| 47 | 300450 | 先导智能  | 34,132,571.13 | 2.58 |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 48 | 000858 | 五 粮 液 | 33,851,925.50 | 2.56 |
| 49 | 002242 | 九阳股份  | 33,839,091.74 | 2.56 |
| 50 | 601398 | 工商银行  | 33,783,693.00 | 2.56 |
| 51 | 600048 | 保利地产  | 33,291,763.76 | 2.52 |
| 52 | 300408 | 三环集团  | 32,982,206.69 | 2.50 |
| 53 | 002456 | 欧菲光   | 32,004,303.00 | 2.42 |
| 54 | 600963 | 岳阳林纸  | 30,671,809.63 | 2.32 |
| 55 | 601877 | 正泰电器  | 30,288,116.79 | 2.29 |
| 56 | 601888 | 中国国旅  | 30,161,110.87 | 2.28 |
| 57 | 002352 | 顺丰控股  | 29,726,758.68 | 2.25 |
| 58 | 600516 | 方大炭素  | 29,557,926.57 | 2.24 |
| 59 | 601288 | 农业银行  | 29,527,870.00 | 2.24 |
| 60 | 601186 | 中国铁建  | 29,511,597.94 | 2.23 |
| 61 | 601601 | 中国太保  | 29,109,283.95 | 2.20 |
| 62 | 002142 | 宁波银行  | 28,660,363.33 | 2.17 |
| 63 | 600585 | 海螺水泥  | 28,500,006.59 | 2.16 |
| 64 | 600919 | 江苏银行  | 28,265,424.00 | 2.14 |
| 65 | 000830 | 鲁西化工  | 27,882,320.00 | 2.11 |
| 66 | 600068 | 葛洲坝   | 27,384,684.00 | 2.07 |
| 67 | 300073 | 当升科技  | 27,331,309.00 | 2.07 |
| 68 | 000402 | 金 融 街 | 26,779,066.82 | 2.03 |
| 69 | 002531 | 天顺风能  | 26,531,915.73 | 2.01 |

注:买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)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  | 002440 | 闰土股份 | 118,684,582.21 | 8.98           |
| 2  | 600352 | 浙江龙盛 | 106,136,991.98 | 8.03           |
| 3  | 601688 | 华泰证券 | 101,850,652.67 | 7.71           |
| 4  | 002714 | 牧原股份 | 77,959,280.34  | 5.90           |
| 5  | 300498 | 温氏股份 | 75,361,117.80  | 5.70           |
| 6  | 600030 | 中信证券 | 74,920,588.92  | 5.67           |
| 7  | 600547 | 山东黄金 | 70,206,394.28  | 5.31           |
| 8  | 600160 | 巨化股份 | 64,973,231.80  | 4.92           |
| 9  | 600284 | 浦东建设 | 59,915,789.10  | 4.54           |
| 10 | 300014 | 亿纬锂能 | 58,250,310.88  | 4.41           |
| 11 | 600837 | 海通证券 | 55,748,390.11  | 4.22           |
| 12 | 300618 | 寒锐钴业 | 53,030,895.49  | 4.01           |
| 13 | 600016 | 民生银行 | 52,759,735.96  | 3.99           |
| 14 | 600050 | 中国联通 | 51,485,786.73  | 3.90           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 15 | 300316 | 晶盛机电 | 50,994,282.22 | 3.86 |
| 16 | 600742 | 一汽富维 | 50,308,356.70 | 3.81 |
| 17 | 601328 | 交通银行 | 50,162,515.80 | 3.80 |
| 18 | 600028 | 中国石化 | 48,330,178.00 | 3.66 |
| 19 | 002648 | 卫星石化 | 45,643,488.00 | 3.45 |
| 20 | 002463 | 沪电股份 | 45,024,174.00 | 3.41 |
| 21 | 000783 | 长江证券 | 44,972,424.13 | 3.40 |
| 22 | 002035 | 华帝股份 | 44,817,673.50 | 3.39 |
| 23 | 600498 | 烽火通信 | 43,933,894.96 | 3.33 |
| 24 | 600259 | 广晟有色 | 42,966,009.16 | 3.25 |
| 25 | 002242 | 九阳股份 | 41,918,664.37 | 3.17 |
| 26 | 601800 | 中国交建 | 41,786,899.20 | 3.16 |
| 27 | 601066 | 中信建投 | 40,589,462.78 | 3.07 |
| 28 | 601933 | 永辉超市 | 39,648,217.00 | 3.00 |
| 29 | 603505 | 金石资源 | 39,493,438.18 | 2.99 |
| 30 | 002422 | 科伦药业 | 39,375,749.93 | 2.98 |
| 31 | 601998 | 中信银行 | 39,205,147.16 | 2.97 |
| 32 | 601100 | 恒立液压 | 38,932,396.25 | 2.95 |
| 33 | 601117 | 中国化学 | 38,699,250.10 | 2.93 |
| 34 | 600000 | 浦发银行 | 38,684,867.05 | 2.93 |
| 35 | 601877 | 正泰电器 | 38,552,913.20 | 2.92 |
| 36 | 601818 | 光大银行 | 38,500,784.00 | 2.91 |
| 37 | 600845 | 宝信软件 | 37,598,291.28 | 2.85 |
| 38 | 603799 | 华友钴业 | 36,880,720.00 | 2.79 |
| 39 | 601318 | 中国平安 | 35,901,947.90 | 2.72 |
| 40 | 300408 | 三环集团 | 35,262,975.94 | 2.67 |
| 41 | 300450 | 先导智能 | 34,939,331.92 | 2.64 |
| 42 | 600048 | 保利地产 | 34,668,690.00 | 2.62 |
| 43 | 600060 | 海信电器 | 34,380,865.00 | 2.60 |
| 44 | 300059 | 东方财富 | 34,094,195.92 | 2.58 |
| 45 | 603899 | 晨光文具 | 33,798,273.00 | 2.56 |
| 46 | 002456 | 欧菲光  | 33,795,247.60 | 2.56 |
| 47 | 601398 | 工商银行 | 33,117,506.53 | 2.51 |
| 48 | 600585 | 海螺水泥 | 31,962,664.28 | 2.42 |
| 49 | 300017 | 网宿科技 | 31,862,396.00 | 2.41 |
| 50 | 002531 | 天顺风能 | 30,760,500.56 | 2.33 |
| 51 | 600516 | 方大炭素 | 30,681,921.80 | 2.32 |
| 52 | 601288 | 农业银行 | 29,114,356.00 | 2.20 |
| 53 | 601601 | 中国太保 | 28,595,458.94 | 2.16 |
| 54 | 600919 | 江苏银行 | 28,175,249.39 | 2.13 |
| 55 | 601186 | 中国铁建 | 27,830,230.00 | 2.11 |
| 56 | 002405 | 四维图新 | 27,645,991.00 | 2.09 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 57 | 002142 | 宁波银行 | 27,364,565.01 | 2.07 |
| 58 | 600068 | 葛洲坝  | 27,006,133.67 | 2.04 |
| 59 | 300601 | 康泰生物 | 26,833,967.32 | 2.03 |
| 60 | 600406 | 国电南瑞 | 26,606,824.58 | 2.01 |

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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 | 5,512,247,902.09 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 5,166,466,956.81 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 142,596,000.00 | 9.72         |
|    | 其中：政策性金融债 | 142,596,000.00 | 9.72         |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 30,459,000.00  | 2.08         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 173,055,000.00 | 11.80        |

### 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  | 140203    | 14 国开 03         | 600,000 | 62,436,000.00 | 4.26         |
| 2  | 180209    | 18 国开 09         | 600,000 | 60,018,000.00 | 4.09         |
| 3  | 101468005 | 14 中铝业<br>MTN001 | 300,000 | 30,459,000.00 | 2.08         |
| 4  | 150402    | 15 农发 02         | 200,000 | 20,142,000.00 | 1.37         |

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货

### 7.10.2 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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体或其分支机构中，苏州东山精密制造股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述情形外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责处罚的情况。

### 7.12.2

本报告期内，本基金投资的前十名股票中没有出现超出基金合同规定的备案股票库的情形。

### 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   | 2,357,546.69 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 5,353,722.63 |
| 5  | 应收申购款   | 199.70       |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 7,711,469.02 |

### 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

本基金本报告期末前十名股票中未有流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## § 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<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>(%) | 持有份额         | 占总份额比例<br>(%) |
| 231          | 9,249,915.21  | 2,135,118,479.97 | 99.92         | 1,611,932.41 | 0.08          |

### 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<br>本基金 | 60,996.61  | 0.003        |

### 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<br>究 | 0                  |

|                 |      |
|-----------------|------|
| 部门负责人持有本开放式基金   |      |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|-----------------|---------------|-----------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,001,375.14 | 0.47            | 10,001,375.14 | 0.47            | 3年         |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -               | -             | -               | -          |
| 基金经理等人员     | 160.53        | -               | -             | -               | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -               | -             | -               | -          |
| 其他          | 60,836.08     | 0.003           | -             | -               | -          |
| 合计          | 10,062,371.75 | 0.473           | 10,001,375.14 | 0.47            | -          |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015年2月10日）基金份额总额 | 13,557,227.44    |
| 本报告期期初基金份额总额              | 2,136,859,144.79 |
| 本报告期基金总申购份额               | 261,565.03       |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 390,297.44       |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额              | 2,136,730,412.38 |

### § 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

1、基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

自2019年1月22日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

### 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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 2 月 10 日）起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。

### 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

本报告期内，基金管理人、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 |    |
| 华泰证券       | 2      | 1,861,625,487.02 | 17.44%       | 794,686.05   | 10.60%     | -  |
| 中银国际       | 1      | 1,525,346,267.43 | 14.29%       | 1,084,976.83 | 14.47%     | -  |
| 申万宏源证券     | 2      | 1,377,082,947.80 | 12.90%       | 1,007,056.33 | 13.43%     | -  |
| 海通证券       | 2      | 2,095,581,486.49 | 19.63%       | 1,532,495.16 | 20.44%     | -  |
| 中泰证券       | 1      | 1,048,851,338.31 | 9.82%        | 767,024.10   | 10.23%     | -  |
| 兴业证券       | 1      | 1,002,198,056.30 | 9.39%        | 933,347.19   | 12.45%     | -  |
| 天风证券       | 2      | 619,888,493.32   | 5.81%        | 453,323.54   | 6.05%      | -  |
| 光大证券股份有限公司 | 1      | 473,811,325.46   | 4.44%        | 346,498.72   | 4.62%      | -  |

|                    |   |                |       |            |       |   |
|--------------------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 公司                 |   |                |       |            |       |   |
| 招商证券               | 1 | 429,330,808.40 | 4.02% | 399,834.18 | 5.33% | - |
| 西南证券               | 1 | 243,266,737.48 | 2.28% | 177,899.31 | 2.37% | - |
| 中信建投               | 2 | -              | -%    | -          | -%    | - |
| 西藏东方财富证券<br>股份有限公司 | 1 | -              | -%    | -          | -%    | - |
| 中原证券               | 2 | -              | -%    | -          | -%    | - |
| 国海证券               | 1 | -              | -%    | -          | -%    | - |

注：1、交易单元的选择标准和程序拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

- (1) 市场形象及财务状况良好。
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (3) 内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (4) 研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

根据上述标准进行考察后，由基金管理人的投资决策委员会确定租用券商的交易单元，并由基金管理人与被选择的券商签订协议。

#### 2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增租用中银国际的 1 个交易单元，海通证券的 1 个交易单元，天风证券的 2 个交易单元，光大证券的 1 个交易单元，西藏东方财富证券股份有限公司的 1 个交易单元。

### 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 |              |
|------------|------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|            | 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 |
| 光大证券股份有限公司 | -    | -%           | 2,280,000,000.00 | 41.96%         | -    | -%           |
| 国海证券       | -    | -%           | -                | -%             | -    | -%           |
| 海通证券       | -    | -%           | -                | -%             | -    | -%           |

|                        |            |      |                  |        |   |    |
|------------------------|------------|------|------------------|--------|---|----|
| 华泰证券                   | -          | -%   | 1,408,000,000.00 | 25.91% | - | -% |
| 申万宏源证券                 | -          | -%   | 282,300,000.00   | 5.20%  | - | -% |
| 天风证券                   | 645,635.20 | 100% | -                | -%     | - | -% |
| 西藏东方财富<br>证券股份有限<br>公司 | -          | -%   | -                | -%     | - | -% |
| 西南证券                   | -          | -%   | -                | -%     | - | -% |
| 兴业证券                   | -          | -%   | -                | -%     | - | -% |
| 招商证券                   | -          | -%   | 613,000,000.00   | 11.28% | - | -% |
| 中泰证券                   | -          | -%   | 850,000,000.00   | 15.64% | - | -% |
| 中信建投                   | -          | -%   | -                | -%     | - | -% |
| 中银国际                   | -          | -%   | -                | -%     | - | -% |
| 中原证券                   | -          | -%   | -                | -%     | - | -% |

### 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  | 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告           | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-01-22 |
| 2  | 太平基金管理有限公司关于增聘徐磊担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-01-31 |
| 3  | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构并参加相关费率优惠活动的公告      | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-03-08 |
| 4  | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构并参加相关费率优惠活动的公告      | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-03-18 |
| 5  | 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-03-26 |
| 6  | 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要               | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-03-26 |
| 7  | 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告               | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-03-27 |
| 8  | 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）           | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-03-27 |
| 9  | 太平灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告           | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-04-19 |
| 10 | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告               | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019-06-21 |

## § 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              | 20190101——20190630      | 2,125,117,104.83 | -    | -    | 2,125,117,104.83 | 99.46    |
| 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，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 |                |                         |                  |      |      |                  |          |

### 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、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室）

### 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：021-61560999

公司网址：[www.taipingfund.com.cn](http://www.taipingfund.com.cn)

太平基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十四日