

太平科创精选混合型发起式证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 19 日

§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责任。

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 2024 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	太平科创精选混合发起式	
基金主代码	019575	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 30 日	
报告期末基金份额总额	10,738,826.35 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金主要投资科创板股票，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金主要投资属于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业的科技创新企业。在资产配置策略和行业优选策略的大框架下，通过定性和定量相结合的个股选择策略，精选具备长期增长潜力的上市公司，以期获得超越行业比较基准的个股正向收益，力争最大化个股收益。	
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率*60%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*10%+中债综合指数收益率*30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	太平科创精选混合发起式 A	太平科创精选混合发起式 C

下属分级基金的交易代码	019575	019574
报告期末下属分级基金的份额总额	10,407,113.26 份	331,713.09 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	太平科创精选混合发起式 A	太平科创精选混合发起式 C
1. 本期已实现收益	-354,372.06	-21,402.16
2. 本期利润	-891,973.65	-27,814.47
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0857	-0.0552
4. 期末基金资产净值	9,473,097.24	301,207.98
5. 期末基金份额净值	0.9103	0.9080

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、所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

太平科创精选混合发起式 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.60%	1.01%	-2.84%	0.87%	-5.76%	0.14%
自基金合同生效起至今	-8.97%	0.80%	0.99%	1.06%	-9.96%	-0.26%

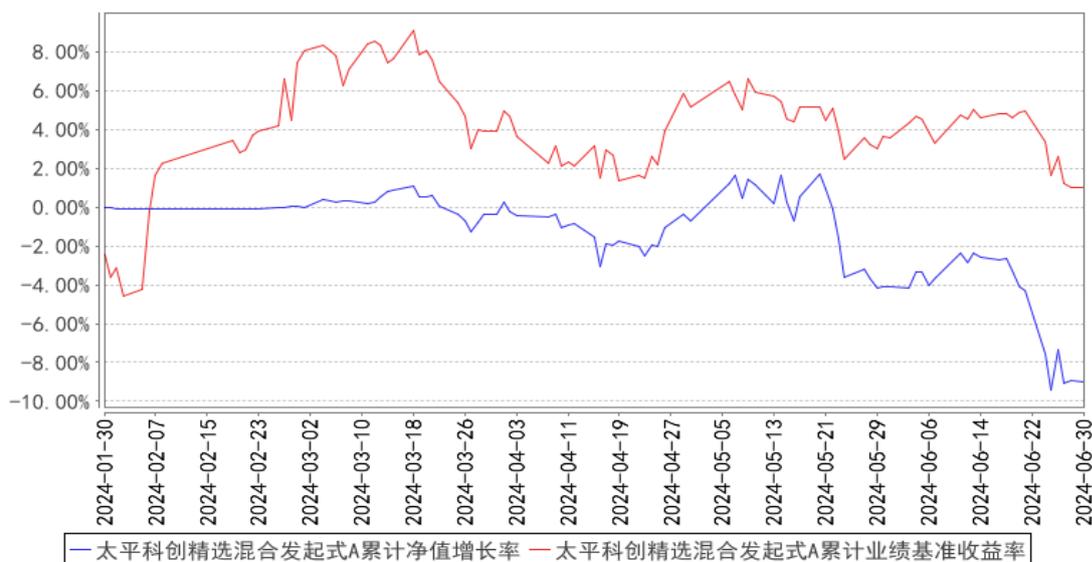
太平科创精选混合发起式 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.74%	1.01%	-2.84%	0.87%	-5.90%	0.14%

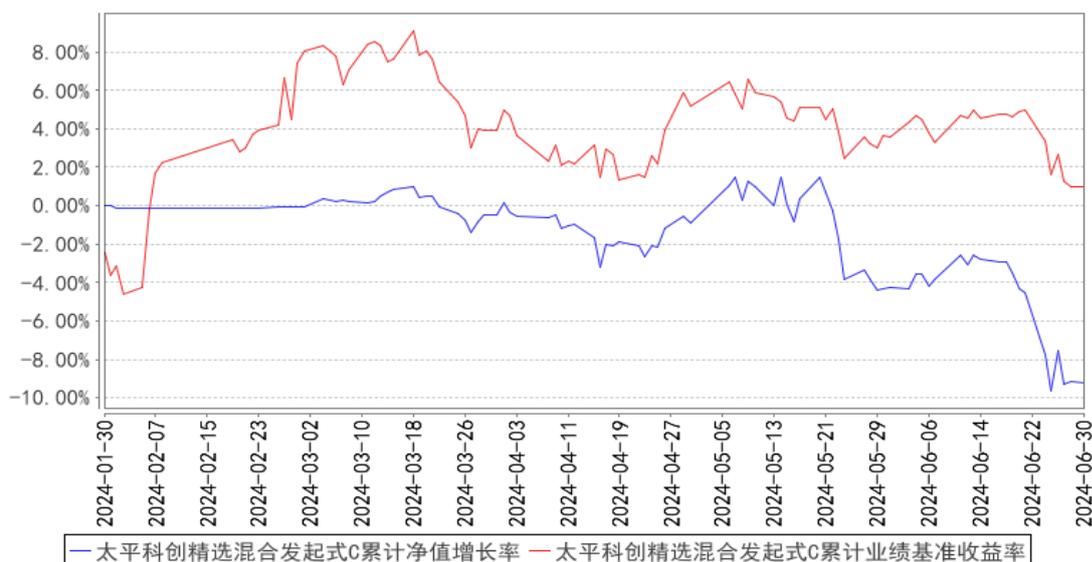
自基金合同 生效起至今	-9.20%	0.80%	0.99%	1.06%	-10.19%	-0.26%
----------------	--------	-------	-------	-------	---------	--------

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

太平科创精选混合发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



太平科创精选混合发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图



注：本基金基金合同生效期为 2024 年 1 月 30 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未
 满一年。本基金的建仓期为基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓
 期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨行远	研究部副总监、本基金的基金经理	2024 年 1 月 30 日	-	9 年	中国科学院化学研究所理学博士。2015 年 4 月起先后担任东兴证券股份有限公司研究所研究员，中国人保资产管理有限公司公募基金事业部高级研究员、高级总监等职。2022 年 9 月加入本公司，现任研究部副总监。2023 年 4 月 19 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。2024 年 1 月 30 日起担任太平科创精选混合型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期一般情况下根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；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、证券基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定；

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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，不存在违法违规或未履行基金合同的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及有关法规，建立公司内部的公平交易管理制度体系，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，以确保公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，防范不公平交易和利益输送行为。

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，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年第二季度，A 股市场震荡下行。具体来看，高股息的银行、电力及公用事业、交通运输、煤等涨幅居前，消费者服务、传媒、商贸零售、计算机、轻工制造、食品饮料等行业跌幅居前。本基金二季度基本完成了建仓，当前仓位重点围绕 AI、半导体、芯片、创新药、数据要素、新质生产力等细分，主要分布在计算机、电子、通信、医药生物、有色、传媒、交运等板块上。

权益市场从二季度 5 月中旬开始调整后，当前或阶段性企稳，A 股整体估值水平仍旧处于中位数以下，虽然当前经济的修复仍需时日，但随着去年的低基数效应，下半年各项经济指标的同比增速有望反弹，本基金将继续重点关注海外科技创新相关、国内新质生产力相关以及自主可控、国企改革等方向。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平科创精选混合发起式 A 的份额净值增长率为-8.60%，同期业绩比较基准收益率为-2.84%；太平科创精选混合发起式 C 的份额净值增长率为-8.74%，同期业绩比较基准收益率为-2.84%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,259,236.72	73.68
	其中：股票	7,259,236.72	73.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,000,000.00	20.30
	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	593,807.38	6.03
8	其他资产	-	-

9	合计	9,853,044.10	100.00
---	----	--------------	--------

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	545,618.00	5.58
C	制造业	3,302,721.84	33.79
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	233,856.00	2.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,177,040.88	32.50
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	7,259,236.72	74.27

5.2.2 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股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002230	科大讯飞	15,600	670,020.00	6.85
2	688631	莱斯信息	10,632	659,396.64	6.75
3	301153	中科江南	21,100	596,286.00	6.10
4	688027	国盾量子	3,557	537,107.00	5.50
5	688192	迪哲医药	9,551	351,858.84	3.60
6	300212	易华录	20,600	346,698.00	3.55
7	688047	龙芯中科	3,942	346,620.06	3.55

8	300418	昆仑万维	9,100	293,384.00	3.00
9	688981	中芯国际	6,148	283,422.80	2.90
10	688012	中微公司	1,986	280,542.36	2.87

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。本基金将构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基

基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在前十名股票中存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	太平科创精选混合发起式 A	太平科创精选混合发起式 C
报告期期初基金份额总额	10,415,054.17	720,598.93
报告期期间基金总申购份额	2,059.09	5,273.43
减:报告期期间基金总赎回份额	10,000.00	394,159.27
报告期期间基金拆分变动份额(份额减)	-	-

少以“-”填列)		
报告期期末基金份额总额	10,407,113.26	331,713.09

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	太平科创精选混合发起式 A	太平科创精选混合发起式 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,755.63	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,755.63	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	96.0954	0.0000

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 报告期末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	10,000,755.63	93.1271	10,000,755.63	93.1271	3 年
基金管理人高级管理人员	-	0.0000	-	0.0000	-
基金经理等人员	-	0.0000	-	0.0000	-
基金管理人股东	-	0.0000	-	0.0000	-
其他	221.00	0.0021	-	0.0000	-
合计	10,000,976.63	93.1292	10,000,755.63	93.1271	3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	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%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

类别		的时间区间					
机构	1	20240401-20240630	10,000,755.63	-	-	-10,000,755.63	93.1271
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。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 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、《太平科创精选混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平科创精选混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平科创精选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

10.2 存放地点

本基金管理人办公地点(地址:上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼、5 楼 503A)

10.3 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、400-028-8699

公司网址:www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2024 年 7 月 19 日