

太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证
券投资基金
2023 年中期报告

2023 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：上海银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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、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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| § 5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 11 |
| 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 | 11 |
| 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 | 11 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 11 |
| 6.1 资产负债表 | 11 |
| 6.2 利润表 | 13 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 14 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| § 7 投资组合报告 | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 37 |
| 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 | 38 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 44 |
| 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 | 44 |
| 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 | 44 |
| 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 | 44 |

| | |
|--|-----------|
| 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 | 44 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 44 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 45 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 46 |
| 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 | 46 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 46 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 46 |
| § 10 重大事件揭示 | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 47 |
| 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 | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 47 |
| 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 | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 47 |
| 10.8 其他重大事件 | 48 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| 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 | 49 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| § 12 备查文件目录 | 49 |
| 12.1 备查文件目录 | 49 |
| 12.2 存放地点 | 50 |
| 12.3 查阅方式 | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------------|
| 基金名称 | 太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 太平嘉和三个月定开债券发起式 |
| 基金主代码 | 015959 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 6 月 27 日 |
| 基金管理人 | 太平基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,588,276,700.63 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在追求资产长期稳健增值的基础上，力争为份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 封闭期主要投资策略包括久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债及资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、杠杆投资策略、可转换债券投资策略以及股票投资策略。开放期基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化，基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率*85%+中证 1000 指数收益率*10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金可能投资港股通标的的股票，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。 |

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 | 上海银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 赵霖 | 周直毅 |
| | 联系电话 | 021-38556613 | 021-68475608 |
| | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn | custody@bosscn.com |
| 客户服务电话 | | 021-61560999/400-028-8699 | 95594 |
| 传真 | | 021-38556677 | 021-68476901 |
| 注册地址 | | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 27 层 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200120 |
| 法定代表人 | | 焦艳军 | 金煜 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.taipingfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 |

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 | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 |

§ 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 50,547,863.18 |
| 本期利润 | 81,484,980.08 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0264 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.65% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.82% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 30,067,926.55 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0066 |
| 期末基金资产净值 | 4,618,344,627.18 |
| 期末基金份额净值 | 1.0066 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 0.66% |

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，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

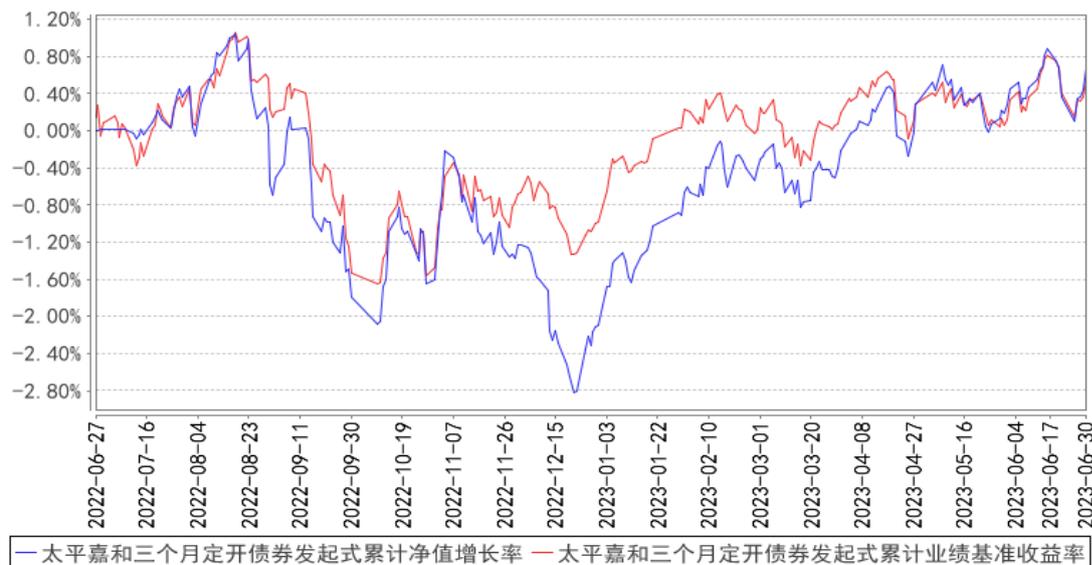
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.47% | 0.15% | 0.48% | 0.14% | -0.01% | 0.01% |
| 过去三个月 | 0.88% | 0.15% | 0.36% | 0.13% | 0.52% | 0.02% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去六个月 | 2.82% | 0.15% | 1.55% | 0.12% | 1.27% | 0.03% |
| 过去一年 | 0.65% | 0.18% | 0.46% | 0.16% | 0.19% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.66% | 0.18% | 0.55% | 0.16% | 0.11% | 0.02% |

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

太平嘉和三个月定开债券发起式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 2022 年 06 月 27 日生效。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 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，2016 年 8 月 22 日更名为太平基金管理有限公司。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

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。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 33 只证券投资基金。

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）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张子权 | 本基金的基金经理、太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理 | 2022 年 6 月 27 日 | - | 6 年 | 英国莱斯特大学理学硕士，具有证券投资基金从业资格。2016 年起先后任职于国金证券上海资产管理分公司、太平资产管理有限公司，历任量化研究员、助理投资经理、投资经理等职。2021 年 11 月加入本公司，从事量化投资研究工作。2022 年 4 月 29 日起担任太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 27 日起担任太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 韩聪 | 本基金的基金经理 | 2022 年 8 月 1 日 | - | 11 年 | 上海财经大学经济学博士，具有证券投资基金从业资格。2011 年 11 月起先后在光大证券股份有限公司、永赢基金管理有限公司、太平资产管理有限公司从事债券投资工作。2014 年 12 月 16 日至 2015 年 4 月 9 日，担任永赢货币市场基金的基金经理。2022 年 2 月加入本公司，2022 年 8 月 1 日起担任太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 甘源 | 本基金的基金经理、太平日日金货币市场基金基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理、太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、太平睿庆混合型证券投资基金基金经理、太平睿庆混合型证券投资基金基金经理、 | 2022 年 6 月 27 日 | - | 8 年 | 清华大学金融硕士，具有证券投资基金从业资格。2015 年起先后在中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、恒大研究院从事资金运营、宏观研究及货币研究等工作。2019 年 11 月加入本公司，担任固定收益投资部基金经理助理。2021 年 2 月 22 日至 2023 年 4 月 10 日担任太平日日金货币市场基金基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2021 年 11 月 18 日起担任太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 21 日起担任太平睿庆混合型证券投资基金基金经理。2022 年 5 月 5 日起担任太平安元债券型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 27 日起担任太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

| | | | | | |
|---------|---|--------------------|---|-----|---|
| | 太平元 债券型证 券投资基 金基金经 理 | | | | |
| 赵鑫 淼 | 本基金的 基金经理 助理、太 平中证 1000 指 数增强型 证券投资 基金基金 经理助理 | 2023 年 1 月 13 日 | - | 4 年 | 上海交通大学应用统计学硕士，具有证券投资基金从业资格。2019 年 4 月起任职于德邦基金管理有限公司，任量化研究员。2022 年 12 月加入本公司，从事量化投资研究工作。2023 年 1 月 13 日起担任太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理助理。2023 年 1 月 13 日起担任太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理。 |

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遵规守信情况的说明

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

本基金股票投资部份，主要采用量化选股策略，在控制波动的基础上，力争获得超额收益。报告期内，虽然市场呈现较为明显的结构化行情，低估值风格及 TMT 相关行业板块出现了较为明显的上涨，但本基金充分发挥风格中性以及行业中性的优势，在结构化行情中较好的控制住了波动。同时报告期内量化选股模型表现较好，帮助管理人实现了超越基准的收益目标。

债券投资部分，由于债券收益率回到年内低点附近，本管理人主要用 2 年以内的信用债替换长久期信用债。

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 2.82%，同期业绩比较基准为 1.55%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，权益方面，经济恢复动能出现放缓迹象，PMI 冲高回落。从需求结构看，二季度外需出现走弱迹象，1-6 月出口金额（以美元计）累计同比下降，低于一季度末 1.7 个百分点。内需中，房地产开发投资依然疲软，制造业投资同比增速回落。由于去年的低基数效应和服务、文娱等接触型消费的拉动，消费回暖但修复节奏分化。CPI 和 PPI 同比持续回落，通胀不会是今年的主线。债券市场方面，无风险收益率一路下行，长短端利率均有不同幅度的回落，其中短端利率回落幅度相对更大，收益率曲线整体“牛陡”。报告期末，长短端利率快速下行，随后止盈情绪回升，叠加偏弱的经济数据使政策预期升温，长债利率略有回调。

展望下半年，宏观上美联储加息进入尾声。权益市场方面，国内资本流出压力或将缓和，利好证券市场。随着证券市场企稳，下半年权益市场低估值板块或有一定超额收益。债券方面，考虑到收益率处于历史较低水平，伴随着政策进一步推出，收益率或面临阶段性回调风险。

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》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）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。公司估值与产品委员会下设估值分委会，常任委员由稽核风控部、投资部门、研究部、基金运营部等部门负责人担任。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

本报告期，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、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、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：太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 3,431,121.65 | 7,682,733.65 |
| 结算备付金 | | 43,959.38 | 1,900,124.70 |
| 存出保证金 | | 30,200,354.65 | 4,771,653.79 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 4,622,463,125.09 | 2,888,561,057.68 |
| 其中：股票投资 | | 871,683,526.91 | 514,660,446.74 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 3,750,779,598.18 | 2,373,900,610.94 |
| 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 | 29,994,076.71 | 17,000,000.00 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 55,644.97 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 4,686,188,282.45 | 2,919,915,569.82 |
| 负债和净资产 | | | |
| 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 | | 65,994,375.18 | 20,080,273.09 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,088,321.98 | 862,511.14 |
| 应付托管费 | | 248,759.28 | 197,145.42 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 213,924.81 | 128,694.63 |

| | | | |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 298,274.02 | 172,985.41 |
| 负债合计 | | 67,843,655.27 | 21,441,609.69 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 4,588,276,700.63 | 2,960,791,943.03 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 30,067,926.55 | -62,317,982.90 |
| 净资产合计 | | 4,618,344,627.18 | 2,898,473,960.13 |
| 负债和净资产总计 | | 4,686,188,282.45 | 2,919,915,569.82 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0066 元，基金份额总额 4,588,276,700.63 份。

6.2 利润表

会计主体：太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 6 月 27 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 90,560,352.87 | 369,511.12 |
| 1. 利息收入 | | 456,786.14 | 369,511.12 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 58,333.15 | 369,511.12 |
| 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 | | 398,452.99 | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-” 填列） | | 59,166,449.83 | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 17,073,948.43 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 34,231,945.75 | - |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 7,860,555.65 | - |
| 以摊余成本计量的 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------------|-------------------|
| 金融资产终止确认产生的收益 | | | |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.20 | 30,937,116.90 | - |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.21 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 9,075,372.79 | 107,003.88 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 5,359,089.03 | 84,290.65 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,224,934.59 | 19,266.43 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 2,291,777.42 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 2,291,777.42 | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 99,514.72 | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 100,057.03 | 3,446.80 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 81,484,980.08 | 262,507.24 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 81,484,980.08 | 262,507.24 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 81,484,980.08 | 262,507.24 |

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | | |
|-----------------|----------------------------|--------|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 2,960,791,943.03 | - | -62,317,982.90 | 2,898,473,960.13 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|---|--------|----------------|------------------|
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 2,960,791,943.03 | - | -62,317,982.90 | 2,898,473,960.13 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 1,627,484,757.60 | - | 92,385,909.45 | 1,719,870,667.05 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 81,484,980.08 | 81,484,980.08 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 1,627,484,757.60 | - | 10,900,929.37 | 1,638,385,686.97 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,627,489,756.10 | - | 10,900,910.49 | 1,638,390,666.59 |
| 2. 基金赎回款 | -4,998.50 | - | 18.88 | -4,979.62 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 4,588,276,700.63 | - | 30,067,926.55 | 4,618,344,627.18 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2022 年 6 月 27 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | - | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 2,929,999,998. | - | - | 2,929,999,998.5 |

| | | | | |
|--|------------------|---|------------|------------------|
| | 50 | | | 0 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | - | - | 262,507.24 | 262,507.24 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 262,507.24 | 262,507.24 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - | - |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 2,929,999,998.50 | - | 262,507.24 | 2,930,262,505.74 |

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：

邓先虎

基金管理人负责人

邓先虎

主管会计工作负责人

王瑞瑾

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平嘉和三个月定期开放债券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[2022]1006号《关于准予太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由太平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《太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公

开募集。本基金为契约型定期开放式基金，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 2,929,999,998.50 元，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）信会师报字[2022]第 ZA31110 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 6 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,929,999,998.50 份，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、股票（包括创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、资产支持证券、银行存款、国债期货、同业存单、债券回购等金融工具，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：债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；港股通标的股票的投资比例不超过基金股票资产的 50% 本基金投资股票、可转换债券和可交换债券合计不超过基金资产的 20% 开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债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投资比例不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，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：中债综合指数收益率*85%+中证 1000 指数收益率*10%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况、2023 年 1 月 1 日至 2023 年

6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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

本基金在本报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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[2008]1 号文《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》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改

为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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，以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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 3,431,121.65 |
| 等于：本金 | 3,430,094.47 |
| 加：应计利息 | 1,027.18 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 3,431,121.65 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | | |
|---------------|------------------------|------------------|------------------|------------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 880,431,758.75 | - | 871,683,526.91 | -8,748,231.84 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 494,903,424.47 | 5,607,778.03 | 498,454,501.83 | -2,056,700.67 |
| | 银行间市场 | 3,212,891,017.62 | 42,847,096.35 | 3,252,325,096.35 | -3,413,017.62 |
| | 合计 | 3,707,794,442.09 | 48,454,874.38 | 3,750,779,598.18 | -5,469,718.29 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 4,588,226,200.84 | 48,454,874.38 | 4,622,463,125.09 | -14,217,950.13 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金于本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金于本报告期末未持有黄金衍生品。

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 2023年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 29,994,076.71 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 29,994,076.71 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金于本报告期末未计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 192,329.73 |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 25,609.25 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 25,609.25 |
| 应付利息 | - |
| 预提信息披露费 | 59,507.37 |
| 预提审计费 | 20,827.67 |
| 合计 | 298,274.02 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,960,791,943.03 | 2,960,791,943.03 |
| 本期申购 | 1,627,489,756.10 | 1,627,489,756.10 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,998.50 | -4,998.50 |
| 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 | 4,588,276,700.63 | 4,588,276,700.63 |

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生其他综合收益。

6.4.7.12 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 | -16,943,289.82 | -45,374,693.08 | -62,317,982.90 |
| 本期利润 | 50,547,863.18 | 30,937,116.90 | 81,484,980.08 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 18,695,100.88 | -7,794,171.51 | 10,900,929.37 |
| 其中：基金申购款 | 18,695,125.45 | -7,794,214.96 | 10,900,910.49 |
| 基金赎回款 | -24.57 | 43.45 | 18.88 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 52,299,674.24 | -22,231,747.69 | 30,067,926.55 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 24,188.75 |
| 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 | 11,381.79 |
| 其他 | 22,762.61 |
| 合计 | 58,333.15 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 17,073,948.43 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 17,073,948.43 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 4,141,287,197.22 |
| 减：卖出股票成本总额 | 4,113,101,536.49 |
| 减：交易费用 | 11,111,712.30 |
| 买卖股票差价收入 | 17,073,948.43 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期无股票投资收益—证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 35,244,889.38 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,012,943.63 |
| 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 | 34,231,945.75 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 517,747,823.11 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 514,170,114.09 |
| 减：应计利息总额 | 4,575,538.56 |
| 减：交易费用 | 15,114.09 |
| 买卖债券差价收入 | -1,012,943.63 |

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 7,860,555.65 |
| 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 | 7,860,555.65 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 30,937,116.90 |
| 股票投资 | 5,912,738.15 |
| 债券投资 | 25,024,378.75 |
| 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税 | - |
| 合计 | 30,937,116.90 |

6.4.7.21 其他收入

本基金在本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 审计费用 | 20,827.67 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 1,114.99 |
| 账户维护费 | 18,607.00 |
| 合计 | 100,057.03 |

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露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

本基金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 |
| 上海银行股份有限公司（“上海银行”） | 基金托管人 |
| 太平人寿保险有限公司（“太平人寿”） | 基金管理人的股东 |

注：上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有通过关联方交易单元进行的股票交易。

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有通过关联方交易单元进行的债券交易。

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有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年6月27日（基金合同生效日）至2022年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,359,089.03 | 84,290.65 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 173.46 | - |

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 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年6月27日（基金合同生效日）至2022年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,224,934.59 | 19,266.43 |

注：支付基金托管人上海银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无

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 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。

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。

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

基金管理人于本报告期内未运用自有资金投资本基金。

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 2023年6月30日 | | 上年度末 2022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(%) |
| 太平人寿 | 4,367,972,180.73 | 95.1985 | 2,899,998,000.00 | 97.9467 |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年6月27日(基金合同生效日)至2022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 |
| 上海银行 | 3,431,121.65 | 24,188.75 | 30,118,398.50 | 118,400.00 |

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2023 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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票减持还需根据交易所相关规定执行。

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|--------|--------|-------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 601298 | 青岛港 | 2023年6月28日 | 重大事项停牌 | 6.97 | 2023年07月03日 | 7.40 | 632,000 | 4,527,714.53 | 4,405,040.00 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 40,002,566.40 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|---------|--------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 190203 | 19 国开 03 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.06 | 211,000 | 21,533,850.68 |
| 1928033 | 19 中国银行二级 03 | 2023 年 7 月 3 日 | 104.30 | 211,000 | 22,007,801.77 |
| 合计 | | | | 422,000 | 43,541,652.45 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 25,991,808.78 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于证券投资基金中较低预期风险/收益的产品。本基金投资的金融工具主要包括具有良好流动性的固定收益类品种。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人上海银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 192,056,656.51 | 230,770,118.59 |
| 合计 | 192,056,656.51 | 230,770,118.59 |

注：未评级债券为金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末及上年度，本基金未持有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

截至本报告期末及上年度，本基金未持有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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 1,796,180,509.20 | 885,012,006.04 |
| AAA 以下 | 1,696,244.27 | 3,672,122.47 |
| 未评级 | 1,760,846,188.20 | 1,254,446,363.84 |
| 合计 | 3,558,722,941.67 | 2,143,130,492.35 |

注：未评级债券为金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末及上年度，本基金未持有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

截至本报告期末及上年度，本基金未持有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

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 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有人民币 65,994,375.18 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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》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公司的证券不得超过该证券的 10%，本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；港股通标的股票的投资比例不超过基金股票资产的 50%；本基金投资股票、可转换债券和可交换债券合计不超过基金资产的 20%(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

通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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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 2023 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未来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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
| | | | | | |

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 3,431,121.65 | - | - | - | 3,431,121.65 |
| 结算备付金 | 43,959.38 | - | - | - | 43,959.38 |
| 存出保证金 | 30,200,354.65 | - | - | - | 30,200,354.65 |
| 交易性金融资产 | 599,995,565.23 | 3,025,402,848.49 | 125,381,184.46 | 871,683,526.91 | 4,622,463,125.09 |
| 买入返售金融资产 | 29,994,076.71 | - | - | - | 29,994,076.71 |
| 应收申购款 | - | - | - | 55,644.97 | 55,644.97 |
| 资产总计 | 663,665,077.62 | 3,025,402,848.49 | 125,381,184.46 | 871,739,171.88 | 4,686,188,282.45 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,088,321.98 | 1,088,321.98 |
| 应付托管费 | - | - | - | 248,759.28 | 248,759.28 |
| 卖出回购金融资产款 | 65,994,375.18 | - | - | - | 65,994,375.18 |
| 应交税费 | - | - | - | 213,924.81 | 213,924.81 |
| 其他负债 | - | - | - | 298,274.02 | 298,274.02 |
| 负债总计 | 65,994,375.18 | - | - | 1,849,280.09 | 67,843,655.27 |
| 利率敏感度缺口 | 597,670,702.44 | 3,025,402,848.49 | 125,381,184.46 | 869,889,891.79 | 4,618,344,627.18 |
| 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 7,682,733.65 | - | - | - | 7,682,733.65 |
| 结算备付金 | 1,900,124.70 | - | - | - | 1,900,124.70 |
| 存出保证金 | 4,771,653.79 | - | - | - | 4,771,653.79 |
| 交易性金融资产 | 234,442,241.06 | 2,067,537,150.70 | 71,921,219.18 | 514,660,446.74 | 2,888,561,057.68 |
| 买入返售金融资产 | 17,000,000.00 | - | - | - | 17,000,000.00 |
| 资产总计 | 265,796,753.20 | 2,067,537,150.70 | 71,921,219.18 | 514,660,446.74 | 2,919,915,569.82 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 20,080,273.09 | - | - | - | 20,080,273.09 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 862,511.14 | 862,511.14 |
| 应付托管费 | - | - | - | 197,145.42 | 197,145.42 |
| 应付税费 | - | - | - | 128,694.63 | 128,694.63 |
| 其他负债 | - | - | - | 172,985.41 | 172,985.41 |
| 负债总计 | 20,080,273.09 | - | - | 1,361,336.60 | 21,441,609.69 |
| 利率敏感度缺口 | 245,716,480.11 | 2,067,537,150.70 | 71,921,219.18 | 513,299,110.14 | 2,898,473,960.13 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | |
|----|---|----------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况 | |
| | 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变 | |
| | 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动 | |
| 分析 | 相关风险变量的变 | 对资产负债表日基金资产净值的 |

| | 动 | 影响金额（单位：人民币元） | |
|--|------------------|-----------------|-------------------|
| | | 本期末（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 17,283,825.76 | 13,384,030.49 |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -17,136,692.26 | -13,258,863.91 |

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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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 2023年6月30日 | | 上年度末 2022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 | 871,683,526.91 | 18.87 | 514,660,446.74 | 17.76 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 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 | 871,683,526.91 | 18.87 | 514,660,446.74 | 17.76 |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值： 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值： 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值： 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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 868,974,731.18 | 514,113,900.21 |
| 第二层次 | 3,753,488,393.91 | 2,374,447,157.47 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 4,622,463,125.09 | 2,888,561,057.68 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：无)。

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工具主要包括应收款项、买入返售金融资产、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本基金本报告期末，无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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 | 871,683,526.91 | 18.60 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：股票 | 871,683,526.91 | 18.60 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,750,779,598.18 | 80.04 |
| | 其中：债券 | 3,750,779,598.18 | 80.04 |
| | 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 | 29,994,076.71 | 0.64 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,475,081.03 | 0.07 |
| 8 | 其他各项资产 | 30,255,999.62 | 0.65 |
| 9 | 合计 | 4,686,188,282.45 | 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

金额单位：人民币元

| 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 | 7,181,248.00 | 0.16 |
| B | 采矿业 | 53,878,324.00 | 1.17 |
| C | 制造业 | 469,306,901.26 | 10.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 38,447,081.35 | 0.83 |
| E | 建筑业 | 18,280,920.97 | 0.40 |
| F | 批发和零售业 | 37,727,952.90 | 0.82 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 25,517,846.00 | 0.55 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 39,991,240.66 | 0.87 |
| J | 金融业 | 93,527,835.61 | 2.03 |
| K | 房地产业 | 12,909,198.00 | 0.28 |
| L | 租赁和商务服务业 | 12,002,318.00 | 0.26 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 25,439,489.16 | 0.55 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 8,188,696.00 | 0.18 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 6,199,040.00 | 0.13 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 23,085,435.00 | 0.50 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 871,683,526.91 | 18.87 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内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 | 600519 | 贵州茅台 | 9,100 | 15,388,100.00 | 0.33 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 1,566,300 | 7,549,566.00 | 0.16 |
| 3 | 601555 | 东吴证券 | 1,071,500 | 7,436,210.00 | 0.16 |
| 4 | 600399 | 抚顺特钢 | 728,900 | 7,434,780.00 | 0.16 |
| 5 | 000683 | 远兴能源 | 1,017,100 | 7,312,949.00 | 0.16 |
| 6 | 600580 | 卧龙电驱 | 491,700 | 7,183,737.00 | 0.16 |
| 7 | 000783 | 长江证券 | 1,227,100 | 7,117,180.00 | 0.15 |
| 8 | 002747 | 埃斯顿 | 243,500 | 6,818,000.00 | 0.15 |
| 9 | 600535 | 天士力 | 468,500 | 6,797,935.00 | 0.15 |
| 10 | 600919 | 江苏银行 | 924,500 | 6,795,075.00 | 0.15 |
| 11 | 002065 | 东华软件 | 961,700 | 6,789,602.00 | 0.15 |
| 12 | 601688 | 华泰证券 | 490,000 | 6,747,300.00 | 0.15 |
| 13 | 601668 | 中国建筑 | 1,172,500 | 6,730,150.00 | 0.15 |
| 14 | 601766 | 中国中车 | 1,033,300 | 6,716,450.00 | 0.15 |
| 15 | 600380 | 健康元 | 527,755 | 6,707,766.05 | 0.15 |
| 16 | 002351 | 漫步者 | 324,300 | 6,706,524.00 | 0.15 |
| 17 | 002152 | 广电运通 | 569,300 | 6,672,196.00 | 0.14 |
| 18 | 600325 | 华发股份 | 676,700 | 6,665,495.00 | 0.14 |
| 19 | 000739 | 普洛药业 | 375,400 | 6,659,596.00 | 0.14 |
| 20 | 600201 | 生物股份 | 699,500 | 6,652,245.00 | 0.14 |
| 21 | 600057 | 厦门象屿 | 762,900 | 6,637,230.00 | 0.14 |
| 22 | 603127 | 昭衍新药 | 161,820 | 6,618,438.00 | 0.14 |
| 23 | 601169 | 北京银行 | 1,426,600 | 6,605,158.00 | 0.14 |
| 24 | 600582 | 天地科技 | 1,132,704 | 6,603,664.32 | 0.14 |
| 25 | 002128 | 电投能源 | 499,100 | 6,598,102.00 | 0.14 |
| 26 | 688088 | 虹软科技 | 154,207 | 6,592,349.25 | 0.14 |
| 27 | 600837 | 海通证券 | 714,200 | 6,584,924.00 | 0.14 |
| 28 | 601179 | 中国西电 | 1,214,300 | 6,569,363.00 | 0.14 |
| 29 | 002038 | 双鹭药业 | 650,800 | 6,566,572.00 | 0.14 |
| 30 | 601607 | 上海医药 | 292,900 | 6,563,889.00 | 0.14 |
| 31 | 600776 | 东方通信 | 458,686 | 6,536,275.50 | 0.14 |
| 32 | 603225 | 新凤鸣 | 590,600 | 6,526,130.00 | 0.14 |
| 33 | 002155 | 湖南黄金 | 534,800 | 6,524,560.00 | 0.14 |
| 34 | 600475 | 华光环能 | 547,700 | 6,506,676.00 | 0.14 |
| 35 | 600598 | 北大荒 | 486,400 | 6,483,712.00 | 0.14 |
| 36 | 600967 | 内蒙一机 | 641,900 | 6,483,190.00 | 0.14 |
| 37 | 600267 | 海正药业 | 568,500 | 6,469,530.00 | 0.14 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 38 | 601608 | 中信重工 | 1,536,600 | 6,469,086.00 | 0.14 |
| 39 | 601158 | 重庆水务 | 1,162,916 | 6,465,812.96 | 0.14 |
| 40 | 688425 | 铁建重工 | 1,338,242 | 6,436,944.02 | 0.14 |
| 41 | 601106 | 中国一重 | 1,914,900 | 6,434,064.00 | 0.14 |
| 42 | 688005 | 容百科技 | 119,066 | 6,431,945.32 | 0.14 |
| 43 | 300769 | 德方纳米 | 58,340 | 6,430,818.20 | 0.14 |
| 44 | 601369 | 陕鼓动力 | 705,400 | 6,426,194.00 | 0.14 |
| 45 | 601618 | 中国中冶 | 1,617,601 | 6,421,875.97 | 0.14 |
| 46 | 002236 | 大华股份 | 324,800 | 6,414,800.00 | 0.14 |
| 47 | 603290 | 斯达半导 | 29,800 | 6,412,960.00 | 0.14 |
| 48 | 002511 | 中顺洁柔 | 575,100 | 6,412,365.00 | 0.14 |
| 49 | 300251 | 光线传媒 | 792,300 | 6,409,707.00 | 0.14 |
| 50 | 002153 | 石基信息 | 457,770 | 6,408,780.00 | 0.14 |
| 51 | 300185 | 通裕重工 | 2,296,200 | 6,406,398.00 | 0.14 |
| 52 | 300628 | 亿联网络 | 182,640 | 6,405,184.80 | 0.14 |
| 53 | 600863 | 内蒙华电 | 1,542,600 | 6,401,790.00 | 0.14 |
| 54 | 601211 | 国泰君安 | 456,300 | 6,383,637.00 | 0.14 |
| 55 | 600597 | 光明乳业 | 613,800 | 6,383,520.00 | 0.14 |
| 56 | 000027 | 深圳能源 | 968,500 | 6,382,415.00 | 0.14 |
| 57 | 601019 | 山东出版 | 695,900 | 6,381,403.00 | 0.14 |
| 58 | 002180 | 纳思达 | 185,900 | 6,367,075.00 | 0.14 |
| 59 | 600760 | 中航沈飞 | 141,460 | 6,365,700.00 | 0.14 |
| 60 | 300347 | 泰格医药 | 98,600 | 6,363,644.00 | 0.14 |
| 61 | 601898 | 中煤能源 | 752,300 | 6,349,412.00 | 0.14 |
| 62 | 600029 | 南方航空 | 1,051,600 | 6,341,148.00 | 0.14 |
| 63 | 600968 | 海油发展 | 2,062,900 | 6,333,103.00 | 0.14 |
| 64 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,187,600 | 6,329,908.00 | 0.14 |
| 65 | 688608 | 恒玄科技 | 52,256 | 6,324,543.68 | 0.14 |
| 66 | 600741 | 华域汽车 | 342,400 | 6,320,704.00 | 0.14 |
| 67 | 600985 | 淮北矿业 | 547,000 | 6,301,440.00 | 0.14 |
| 68 | 600015 | 华夏银行 | 1,164,200 | 6,298,322.00 | 0.14 |
| 69 | 601615 | 明阳智能 | 373,100 | 6,297,928.00 | 0.14 |
| 70 | 603043 | 广州酒家 | 222,687 | 6,293,134.62 | 0.14 |
| 71 | 000761 | 本钢板材 | 1,572,700 | 6,290,800.00 | 0.14 |
| 72 | 603861 | 白云电器 | 655,200 | 6,289,920.00 | 0.14 |
| 73 | 002749 | 国光股份 | 551,438 | 6,247,792.54 | 0.14 |
| 74 | 300759 | 康龙化成 | 163,000 | 6,239,640.00 | 0.14 |
| 75 | 000030 | 富奥股份 | 1,237,781 | 6,238,416.24 | 0.14 |
| 76 | 003816 | 中国广核 | 2,003,600 | 6,231,196.00 | 0.13 |
| 77 | 600183 | 生益科技 | 438,200 | 6,222,440.00 | 0.13 |
| 78 | 600362 | 江西铜业 | 327,600 | 6,217,848.00 | 0.13 |
| 79 | 688287 | 观典防务 | 428,516 | 6,217,767.16 | 0.13 |
| 80 | 600763 | 通策医疗 | 64,000 | 6,199,040.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 81 | 600383 | 金地集团 | 857,200 | 6,180,412.00 | 0.13 |
| 82 | 600025 | 华能水电 | 865,500 | 6,171,015.00 | 0.13 |
| 83 | 603013 | 亚普股份 | 393,500 | 6,170,080.00 | 0.13 |
| 84 | 603839 | 安正时尚 | 817,200 | 6,145,344.00 | 0.13 |
| 85 | 300842 | 帝科股份 | 67,100 | 6,135,624.00 | 0.13 |
| 86 | 300957 | 贝泰妮 | 69,000 | 6,132,720.00 | 0.13 |
| 87 | 601916 | 浙商银行 | 2,321,230 | 6,128,047.20 | 0.13 |
| 88 | 000800 | 一汽解放 | 731,600 | 6,123,492.00 | 0.13 |
| 89 | 603615 | 茶花股份 | 646,700 | 6,104,848.00 | 0.13 |
| 90 | 002287 | 奇正藏药 | 255,300 | 6,101,670.00 | 0.13 |
| 91 | 600828 | 茂业商业 | 1,643,400 | 6,080,580.00 | 0.13 |
| 92 | 000426 | 兴业矿业 | 684,200 | 6,075,696.00 | 0.13 |
| 93 | 603948 | 建业股份 | 282,053 | 6,064,139.50 | 0.13 |
| 94 | 603053 | 成都燃气 | 601,177 | 6,053,852.39 | 0.13 |
| 95 | 300133 | 华策影视 | 852,200 | 6,042,098.00 | 0.13 |
| 96 | 601857 | 中国石油 | 808,000 | 6,035,760.00 | 0.13 |
| 97 | 300798 | 锦鸡股份 | 835,500 | 5,982,180.00 | 0.13 |
| 98 | 002461 | 珠江啤酒 | 676,500 | 5,959,965.00 | 0.13 |
| 99 | 601228 | 广州港 | 1,840,300 | 5,944,169.00 | 0.13 |
| 100 | 600315 | 上海家化 | 204,900 | 5,944,149.00 | 0.13 |
| 101 | 601727 | 上海电气 | 1,296,800 | 5,926,376.00 | 0.13 |
| 102 | 600548 | 深高速 | 659,200 | 5,919,616.00 | 0.13 |
| 103 | 000950 | 重药控股 | 874,100 | 5,882,693.00 | 0.13 |
| 104 | 688180 | 君实生物 | 152,188 | 5,865,325.52 | 0.13 |
| 105 | 688116 | 天奈科技 | 127,970 | 5,854,627.50 | 0.13 |
| 106 | 002273 | 水晶光电 | 487,000 | 5,814,780.00 | 0.13 |
| 107 | 601319 | 中国人保 | 976,400 | 5,702,176.00 | 0.12 |
| 108 | 600562 | 国睿科技 | 350,800 | 5,682,960.00 | 0.12 |
| 109 | 600755 | 厦门国贸 | 731,300 | 5,660,262.00 | 0.12 |
| 110 | 600702 | 舍得酒业 | 44,800 | 5,552,960.00 | 0.12 |
| 111 | 600901 | 江苏租赁 | 1,340,612 | 5,536,727.56 | 0.12 |
| 112 | 000960 | 锡业股份 | 349,200 | 5,430,060.00 | 0.12 |
| 113 | 603515 | 欧普照明 | 265,547 | 5,390,604.10 | 0.12 |
| 114 | 688318 | 财富趋势 | 51,693 | 5,167,749.21 | 0.11 |
| 115 | 601186 | 中国铁建 | 520,700 | 5,128,895.00 | 0.11 |
| 116 | 000898 | 鞍钢股份 | 1,798,200 | 4,998,996.00 | 0.11 |
| 117 | 600566 | 济川药业 | 170,900 | 4,962,936.00 | 0.11 |
| 118 | 300624 | 万兴科技 | 40,600 | 4,756,290.00 | 0.10 |
| 119 | 601577 | 长沙银行 | 603,300 | 4,681,608.00 | 0.10 |
| 120 | 002505 | 鹏都农牧 | 2,460,670 | 4,650,666.30 | 0.10 |
| 121 | 600184 | 光电股份 | 347,400 | 4,561,362.00 | 0.10 |
| 122 | 601298 | 青岛港 | 632,000 | 4,405,040.00 | 0.10 |
| 123 | 601928 | 凤凰传媒 | 329,100 | 3,751,740.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 124 | 600180 | 瑞茂通 | 613,200 | 3,666,936.00 | 0.08 |
| 125 | 603236 | 移远通信 | 62,200 | 3,589,562.00 | 0.08 |
| 126 | 300113 | 顺网科技 | 206,900 | 3,560,749.00 | 0.08 |
| 127 | 603879 | 永悦科技 | 522,500 | 3,542,550.00 | 0.08 |
| 128 | 601888 | 中国中免 | 29,000 | 3,205,370.00 | 0.07 |
| 129 | 603353 | 和顺石油 | 168,390 | 3,162,364.20 | 0.07 |
| 130 | 601799 | 星宇股份 | 25,000 | 3,090,000.00 | 0.07 |
| 131 | 002791 | 坚朗五金 | 45,593 | 2,950,323.03 | 0.06 |
| 132 | 688082 | 盛美上海 | 25,550 | 2,820,720.00 | 0.06 |
| 133 | 603858 | 步长制药 | 136,100 | 2,802,299.00 | 0.06 |
| 134 | 300438 | 鹏辉能源 | 55,300 | 2,656,612.00 | 0.06 |
| 135 | 002049 | 紫光国微 | 28,000 | 2,611,000.00 | 0.06 |
| 136 | 601658 | 邮储银行 | 480,700 | 2,350,623.00 | 0.05 |
| 137 | 688327 | 云从科技 | 134,624 | 2,328,995.20 | 0.05 |
| 138 | 002410 | 广联达 | 70,800 | 2,300,292.00 | 0.05 |
| 139 | 601818 | 光大银行 | 719,300 | 2,208,251.00 | 0.05 |
| 140 | 603893 | 瑞芯微 | 30,100 | 2,192,785.00 | 0.05 |
| 141 | 688029 | 南微医学 | 26,606 | 2,169,985.36 | 0.05 |
| 142 | 002344 | 海宁皮城 | 456,600 | 2,159,718.00 | 0.05 |
| 143 | 600418 | 江淮汽车 | 158,600 | 1,996,774.00 | 0.04 |
| 144 | 600390 | 五矿资本 | 353,300 | 1,900,754.00 | 0.04 |
| 145 | 000987 | 越秀资本 | 295,831 | 1,878,526.85 | 0.04 |
| 146 | 603848 | 好太太 | 111,500 | 1,784,000.00 | 0.04 |
| 147 | 000400 | 许继电气 | 74,800 | 1,724,140.00 | 0.04 |
| 148 | 601827 | 三峰环境 | 227,300 | 1,682,020.00 | 0.04 |
| 149 | 600981 | 汇鸿集团 | 569,800 | 1,652,420.00 | 0.04 |
| 150 | 601006 | 大秦铁路 | 222,300 | 1,651,689.00 | 0.04 |
| 151 | 601601 | 中国太保 | 62,500 | 1,623,750.00 | 0.04 |
| 152 | 002156 | 通富微电 | 71,000 | 1,604,600.00 | 0.03 |
| 153 | 601088 | 中国神华 | 49,000 | 1,506,750.00 | 0.03 |
| 154 | 002946 | 新乳业 | 103,100 | 1,479,485.00 | 0.03 |
| 155 | 601717 | 郑煤机 | 117,900 | 1,467,855.00 | 0.03 |
| 156 | 300130 | 新国都 | 50,700 | 1,436,331.00 | 0.03 |
| 157 | 603958 | 哈森股份 | 187,200 | 1,435,824.00 | 0.03 |
| 158 | 002131 | 利欧股份 | 613,300 | 1,410,590.00 | 0.03 |
| 159 | 002014 | 永新股份 | 155,200 | 1,347,136.00 | 0.03 |
| 160 | 002120 | 韵达股份 | 131,400 | 1,256,184.00 | 0.03 |
| 161 | 002250 | 联化科技 | 111,000 | 1,161,060.00 | 0.03 |
| 162 | 000895 | 双汇发展 | 47,200 | 1,155,928.00 | 0.03 |
| 163 | 601225 | 陕西煤业 | 60,000 | 1,091,400.00 | 0.02 |
| 164 | 600249 | 两面针 | 176,300 | 969,650.00 | 0.02 |
| 165 | 002085 | 万丰奥威 | 108,600 | 752,598.00 | 0.02 |
| 166 | 000883 | 湖北能源 | 162,500 | 741,000.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 167 | 600488 | 津药药业 | 131,800 | 740,716.00 | 0.02 |
| 168 | 600339 | 中油工程 | 179,900 | 732,193.00 | 0.02 |
| 169 | 601118 | 海南橡胶 | 155,700 | 697,536.00 | 0.02 |
| 170 | 600718 | 东软集团 | 63,400 | 675,844.00 | 0.01 |
| 171 | 002460 | 赣锋锂业 | 10,000 | 609,600.00 | 0.01 |
| 172 | 601636 | 旗滨集团 | 63,800 | 549,956.00 | 0.01 |
| 173 | 002130 | 沃尔核材 | 66,000 | 535,920.00 | 0.01 |
| 174 | 601801 | 皖新传媒 | 53,300 | 500,487.00 | 0.01 |
| 175 | 002252 | 上海莱士 | 65,300 | 490,403.00 | 0.01 |
| 176 | 300154 | 瑞凌股份 | 55,800 | 446,958.00 | 0.01 |
| 177 | 002563 | 森马服饰 | 70,300 | 437,266.00 | 0.01 |
| 178 | 002092 | 中泰化学 | 60,000 | 387,000.00 | 0.01 |
| 179 | 002730 | 电光科技 | 35,400 | 339,132.00 | 0.01 |
| 180 | 603680 | 今创集团 | 32,304 | 335,315.52 | 0.01 |
| 181 | 603677 | 奇精机械 | 23,400 | 316,602.00 | 0.01 |
| 182 | 002697 | 红旗连锁 | 49,900 | 291,416.00 | 0.01 |
| 183 | 603928 | 兴业股份 | 20,400 | 246,228.00 | 0.01 |
| 184 | 000738 | 航发控制 | 10,000 | 244,000.00 | 0.01 |
| 185 | 601222 | 林洋能源 | 27,300 | 223,587.00 | 0.00 |
| 186 | 600983 | 惠而浦 | 28,900 | 219,351.00 | 0.00 |
| 187 | 600827 | 百联股份 | 8,600 | 114,982.00 | 0.00 |
| 188 | 002913 | 奥士康 | 2,000 | 76,360.00 | 0.00 |
| 189 | 603589 | 口子窖 | 1,500 | 74,025.00 | 0.00 |
| 190 | 600639 | 浦东金桥 | 5,100 | 63,291.00 | 0.00 |
| 191 | 300751 | 迈为股份 | 168 | 28,455.84 | 0.00 |
| 192 | 603317 | 天味食品 | 960 | 14,025.60 | 0.00 |
| 193 | 000028 | 国药一致 | 40 | 1,744.40 | 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 | 601319 | 中国人保 | 22,196,583.00 | 0.77 |
| 2 | 601857 | 中国石油 | 21,418,744.00 | 0.74 |
| 3 | 600967 | 内蒙一机 | 19,111,578.00 | 0.66 |
| 4 | 603225 | 新凤鸣 | 18,039,133.16 | 0.62 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 17,202,538.00 | 0.59 |
| 6 | 002152 | 广电运通 | 17,099,896.00 | 0.59 |
| 7 | 000426 | 兴业矿业 | 16,788,220.00 | 0.58 |
| 8 | 601688 | 华泰证券 | 16,468,945.00 | 0.57 |
| 9 | 000739 | 普洛药业 | 16,405,907.18 | 0.57 |
| 10 | 601801 | 皖新传媒 | 16,370,785.00 | 0.56 |
| 11 | 002080 | 中材科技 | 16,187,011.46 | 0.56 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 601138 | 工业富联 | 16,034,889.00 | 0.55 |
| 13 | 688166 | 博瑞医药 | 16,014,997.13 | 0.55 |
| 14 | 600201 | 生物股份 | 15,854,091.00 | 0.55 |
| 15 | 600548 | 深高速 | 15,646,722.25 | 0.54 |
| 16 | 002505 | 鹏都农牧 | 15,626,682.00 | 0.54 |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 15,586,128.00 | 0.54 |
| 18 | 600582 | 天地科技 | 14,961,813.87 | 0.52 |
| 19 | 000785 | 居然之家 | 14,822,830.00 | 0.51 |
| 20 | 000898 | 鞍钢股份 | 14,656,223.00 | 0.51 |

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 | 601318 | 中国平安 | 22,093,134.00 | 0.76 |
| 2 | 601857 | 中国石油 | 20,386,599.00 | 0.70 |
| 3 | 601801 | 皖新传媒 | 16,924,806.00 | 0.58 |
| 4 | 601319 | 中国人保 | 16,897,880.00 | 0.58 |
| 5 | 601138 | 工业富联 | 16,262,828.00 | 0.56 |
| 6 | 000028 | 国药一致 | 16,063,379.80 | 0.55 |
| 7 | 002080 | 中材科技 | 15,870,205.00 | 0.55 |
| 8 | 688166 | 博瑞医药 | 15,242,647.11 | 0.53 |
| 9 | 000785 | 居然之家 | 15,172,550.00 | 0.52 |
| 10 | 601519 | 大智慧 | 14,951,485.60 | 0.52 |
| 11 | 300751 | 迈为股份 | 14,425,116.88 | 0.50 |
| 12 | 603278 | 大业股份 | 13,924,036.15 | 0.48 |
| 13 | 600572 | 康恩贝 | 13,890,972.50 | 0.48 |
| 14 | 601006 | 大秦铁路 | 13,799,366.00 | 0.48 |
| 15 | 300438 | 鹏辉能源 | 13,355,025.04 | 0.46 |
| 16 | 689009 | 九号公司 | 13,216,676.26 | 0.46 |
| 17 | 600967 | 内蒙一机 | 13,021,252.19 | 0.45 |
| 18 | 601390 | 中国中铁 | 12,760,429.00 | 0.44 |
| 19 | 002463 | 沪电股份 | 12,655,350.73 | 0.44 |
| 20 | 688571 | 杭华股份 | 12,611,130.55 | 0.44 |

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 | 4,464,211,878.51 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,141,287,197.22 |

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 | 622,821,968.09 | 13.49 |
| | 其中：政策性金融债 | 233,317,341.98 | 5.05 |
| 4 | 企业债券 | 232,634,815.91 | 5.04 |
| 5 | 企业短期融资券 | 60,795,478.91 | 1.32 |
| 6 | 中期票据 | 2,832,831,091.00 | 61.34 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,696,244.27 | 0.04 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,750,779,598.18 | 81.21 |

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 | 102280974 | 22 陕延油 MTN001 | 1,800,000 | 181,651,868.85 | 3.93 |
| 2 | 230201 | 23 国开 01 | 1,300,000 | 131,261,177.60 | 2.84 |
| 3 | 102101795 | 21 宝钢 MTN001(可持 续挂钩) | 1,000,000 | 102,932,920.55 | 2.23 |
| 4 | 190203 | 19 国开 03 | 1,000,000 | 102,056,164.38 | 2.21 |
| 5 | 102281841 | 22 中电投 MTN025 | 1,000,000 | 101,773,090.41 | 2.20 |

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国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值

操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.10.2 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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中，广发证券股份有限公司本期出现被监管部门立案调查的情形。

7.11.2 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。

7.11.3 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 | 30,200,354.65 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 55,644.97 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 30,255,999.62 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 113047 | 旗滨转债 | 1,696,244.27 | 0.04 |

7.11.5 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不存在流通受限情况。

7.11.6 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。

§ 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 (%) |
| 15 | 305,885,113.38 | 4,588,101,089.50 | 99.9962 | 175,611.13 | 0.0038 |

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 | 119,829.91 | 0.0026 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10 |
| 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 | - | 0.0000 | - | 0.0000 | - |
| 基金管理人高级 管理人员 | 79,348.72 | 0.0017 | - | 0.0000 | |
| 基金经理等人员 | 99.85 | 0.0000 | - | 0.0000 | - |
| 基金管理人股东 | 4,367,972,180.73 | 95.1985 | 2,899,998,000.00 | 63.2045 | 3年 |
| 其他 | 40,381.34 | 0.0009 | - | 0.0000 | |
| 合计 | 4,368,092,010.64 | 95.2011 | 2,899,998,000.00 | 63.2045 | 3年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2022 年 6 月 27 日) 基金份额总额 | 2,929,999,998.50 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,960,791,943.03 |

| | |
|---------------|------------------|
| 本报告期基金总申购份额 | 1,627,489,756.10 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 4,998.50 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,588,276,700.63 |

§ 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、基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于 2023 年 6 月 17 日发布公告，自 2023 年 6 月 16 日起董晓亮先生不再担任公司副总经理职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2023 年 3 月，项寅同志担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务，上述人事变动已进行备案、公告。

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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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，本公司及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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 (%) | |
| 中国银河证券 | 2 | 8,604,506,166.41 | 100.00 | 6,293,810.73 | 100.00 | - |

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，基金租用证券公司交易单元无变化。

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 (%) |
| 中国银河证券 | 163,767,201.85 | 100.00 | 3,862,227.00 0.00 | 100.00 | - | - |

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 | 关于太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换等业务公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 1 月 19 日 |
| 2 | 太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年第四季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 3 | 太平基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基 | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 3 月 8 日 |

| | | | |
|---|---|-----------|-----------------|
| | 金销售业务的公告 | | |
| 4 | 太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 3 月 30 日 |
| 5 | 太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 4 月 20 日 |
| 6 | 太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 1 号） | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 4 月 20 日 |
| 7 | 太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第一季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 8 | 关于太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换等业务公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 5 月 31 日 |

§ 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 | 20230101-20230630 | 2,899,998,000.00 | 1,467,974,180.73 | - | 4,367,972,180.73 | 95.1985 |
| 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。 | | | | | | | |

注：报告期末同一投资者通过多个基金账户持有本基金的合并计算。

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、《太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》

4、《太平嘉和三个月定期开放债券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：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼）

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：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日