

太平智行三个月定期开放混合型发起式证
券投资基金
2024 年中期报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 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 | 7 |
| 2.4 信息披露方式 | 7 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 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 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 41 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 45 |
| 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 | 45 |
| 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 | 45 |
| 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 | 45 |

| | |
|--|-----------|
| 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 | 46 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 46 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 46 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 46 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 47 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 47 |
| 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 | 47 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 47 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 48 |
| § 10 重大事件揭示 | 48 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 48 |
| 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 | 48 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 48 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 49 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 49 |
| 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 | 49 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 49 |
| 10.8 其他重大事件 | 50 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 51 |
| 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 | 51 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 51 |
| § 12 备查文件目录 | 51 |
| 12.1 备查文件目录 | 51 |
| 12.2 存放地点 | 52 |
| 12.3 查阅方式 | 52 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------------|
| 基金名称 | 太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 太平智行三个月定期开放混合发起式 |
| 基金主代码 | 013422 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 8 月 25 日 |
| 基金管理人 | 太平基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 800,000,018.38 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金在管理风险的前提下，重点投资高质量成长型上市公司，谋求基金资产的中长期增值。 |
| 投资策略 | <p>(一) 封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 行业选择策略</p> <p>行业分析上，本基金主要通过对经济结构转型与资本周期分析，结合产业政策导向等研究，密切跟踪行业需求和供给端变化。重点投资于竞争格局改善，景气度向好且具有一定可持续性的行业。</p> <p>(2) 个股选择策略</p> <p>公司选择上，本基金秉承未来自由现金流折现是评估企业内在价值的唯一标准。根据现金流折现公式，成长因子本身就是企业价值中不可忽视的变量。企业的成长属性将决定其未来价值增值的质量，而“价值”代表了稳健的资产结构和现金流，优秀的管理运营，良好的战略规划等，可以说价值决定企业的成长潜力。</p> <p>本基金采取均衡策略，做价值与成长的权衡，做风险与收益的平衡，强调“安全边际”和风险收益比。采用“四度选股方法”为基础，分别从“时间维度、企业投资角度、期望值综合度和市场认可度”四个维度分析，以企业价值为评估标准，从企业盈利能力，盈利的确定性、成长性、持续性等角度入手，聚焦于未来 3-5 年存在良好的增值可能的公司，以合理的分散化形成投资组合。期望通过“深度研究、重点持仓”的投资组合来获得超越市场平均水平的收益。</p> <p>(3) 港股通标的股票的投资策略</p> |

| | |
|--|---|
| | <p>本基金将采用与 A 股市场相同的个股精选策略，从企业盈利能力，盈利的确定性、成长性、持续性等角度入手，精选未来 3-5 年存在良好的增值可能的投资标的。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略：</p> <p>（1）久期调整策略</p> <p>根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。</p> <p>（2）收益率曲线配置策略</p> <p>在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。</p> <p>（3）债券类属配置策略</p> <p>根据国债、金融债、公司债、可转债、可交换债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个股选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>7、股票期权投资策略</p> <p>股票期权为本基金辅助投资工具。本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为目的参与股票期权投资。股票期权的投资原则为控制下跌风险，降低建仓或调仓过程中的冲击成本。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>在开放期，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不</p> |
|--|---|

| | |
|--------|---|
| | 断变化，基金管理人将采取各种有效管理措施，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，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 | 本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+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×40%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。本基金可能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。 |

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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 赵霖 |
| | 联系电话 | 021-38556613 |
| | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn |
| 客户服务电话 | 021-61560999/400-028-8699 | 95599 |
| 传真 | 021-38556677 | 010-68121816 |
| 注册地址 | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室 | 北京市东城区建国门内大街 69 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 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9 |
| 邮政编码 | 200120 | 100031 |
| 法定代表人 | 焦艳军 | 谷澍 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -39,617,567.31 |
| 本期利润 | -8,437,117.79 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0105 |
| 本期加权平均净值利润率 | -1.69% |

| | |
|---------------|------------------|
| 本期基金份额净值增长率 | -1.64% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | -310,532,512.60 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3882 |
| 期末基金资产净值 | 503,578,872.26 |
| 期末基金份额净值 | 0.6295 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -37.05% |

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。

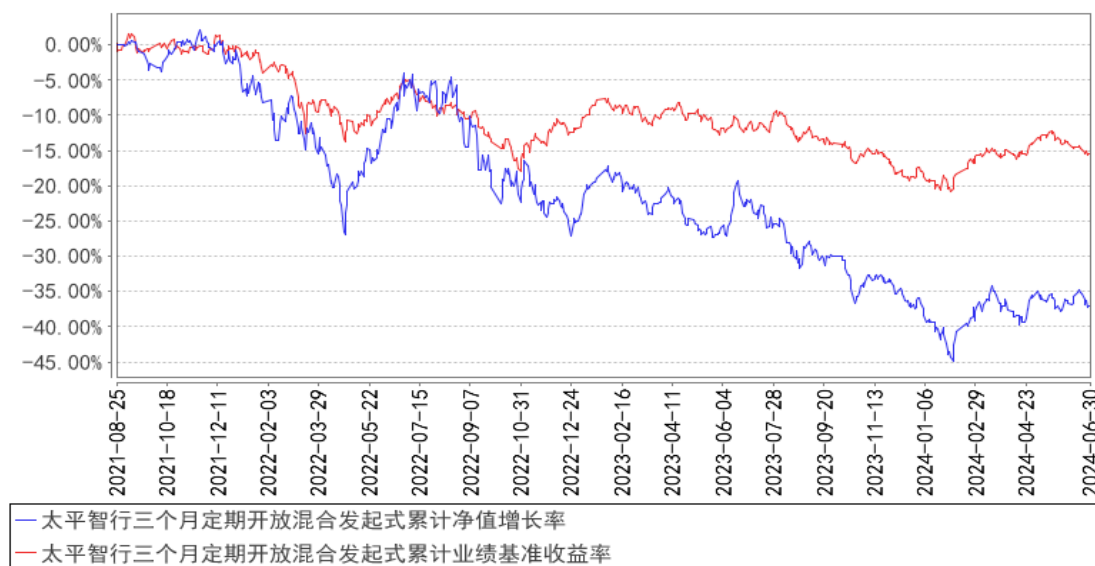
3.2 基金净值表现

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 | 0.91% | 0.87% | -1.58% | 0.28% | 2.49% | 0.59% |
| 过去三个月 | -0.13% | 0.99% | 0.17% | 0.43% | -0.30% | 0.56% |
| 过去六个月 | -1.64% | 1.18% | 2.21% | 0.53% | -3.85% | 0.65% |
| 过去一年 | -19.34% | 1.07% | -4.15% | 0.52% | -15.19% | 0.55% |
| 自基金合同生效起至今 | -37.05% | 1.19% | -15.45% | 0.62% | -21.60% | 0.57% |

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

太平智行三个月定期开放混合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：本基金基金合同生效日为 2021 年 8 月 25 日，本基金的建仓期为六个月，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，通过科学合理的资产配置策略，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 39 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 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|----|--------------|--------------------|---|------|---|
| 常璐 | 本基金的 基金经理 | 2021 年 8 月 25 日 | - | 13 年 | 上海财经大学会计学硕士。2011 年起先后任职于申银万国、华安基金、华夏久盈资管、上银基金，历任行业研究员、投资经理、研究总监、基金经理等职。2018 年 9 月加入本公司，从事投资研究工作。2020 年 3 月 24 日至 2024 年 1 月 9 日担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 14 日起担任太平智选一年定期开放股票型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 25 日起担任太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 1 月 20 日起担任太平消费升级一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 8 月 15 日起担任太平低碳经济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，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非公平交易的情况。

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 1 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

2024 年上半年，A 股呈现 V 型走势。1 月-2 月初市场在基本面和资金面等利空因素扰动下市场快速下行，春节后随着积极的政策陆续出台，资金面也出现积极变化，市场在风险偏好的快速修复下出现快速反弹。稳增长政策在二季度进一步延续，市场在经历反弹后窄幅震旦，行业快速轮动。本基金在报告期内保持中性仓位，适度减持食品饮料、医药生物，适度增配港股互联网、公用事业、交运、有色、机械，底部逐步增配电新、军工，结构上仍然保持相对均衡。

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-1.64%，同期业绩比较基准为 2.21%。

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 2024 年下半年，我们预计前期政策效果将逐步显现，特别是设备更新改造和消费品以旧换新以及地产政策的调整优化将推动下半年经济走稳。三中全会定调中长期改革方向进一步明晰，市场情绪也将逐步修复。当前市场估值仍处于历史相对低位，从市场的定价角度考虑，权益资产价格仍具备较高吸引力，我们看好市场风险偏好的修复和经济增长中枢预期的抬升，本基金后续仍然坚持均衡的风格，聚焦基本面，自下而上挖掘标的。

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，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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。公司管理层下设立估值委员会，常任委员由公司总经理、分管投资部门、研究部、运营部高管及稽核风控部、投资部门（含权益投资部、专户业务部、固定收益投资部）、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

根据法律法规的规定及《太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 8 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%。

本基金管理人在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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—太平基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，太平基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为，太平基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 95,904,201.04 | 132,346,291.24 |
| 结算备付金 | | 762,821.83 | 902,481.66 |
| 存出保证金 | | 168,444.68 | 182,902.48 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 405,195,433.98 | 376,035,635.61 |
| 其中：股票投资 | | 402,288,215.13 | 373,022,839.53 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,907,218.85 | 3,012,796.08 |
| 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 | - | - |
| 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 | | 3,990,229.07 | 3,855,097.76 |
| 应收股利 | | 339,441.34 | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 506,360,571.94 | 513,322,408.75 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 1,489,733.42 | 6.24 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 459,848.93 | 480,522.93 |
| 应付托管费 | | 83,608.91 | 87,367.81 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 34.94 | 21.88 |
| 应付利润 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 748,473.48 | 738,493.44 |
| 负债合计 | | 2,781,699.68 | 1,306,412.30 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 800,000,018.38 | 800,000,028.70 |
| 未分配利润 | 6.4.7.11 | -296,421,146.12 | -287,984,032.25 |
| 净资产合计 | | 503,578,872.26 | 512,015,996.45 |
| 负债和净资产总计 | | 506,360,571.94 | 513,322,408.75 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.6295 元，基金份额总额 800,000,018.38 份。

6.2 利润表

会计主体：太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -5,141,649.39 | 28,910,591.93 |
| 1. 利息收入 | | 443,081.57 | 262,052.69 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.12 | 443,081.57 | 262,052.69 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -36,765,180.48 | -49,407,176.03 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.13 | -40,641,677.85 | -52,696,707.94 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | 6,216.94 | 3,270.91 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.15 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.18 | 3,870,280.43 | 3,286,261.00 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | 31,180,449.52 | 78,055,715.27 |
| 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. 20 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 3, 295, 468. 40 | 4, 086, 066. 24 |
| 1. 管理人报酬 | 6. 4. 10. 2. 1 | 2, 719, 474. 61 | 3, 385, 682. 35 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6. 4. 10. 2. 2 | 494, 449. 87 | 615, 578. 65 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6. 4. 7. 21 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 22. 44 | 11. 89 |
| 8. 其他费用 | 6. 4. 7. 22 | 81, 521. 48 | 84, 793. 35 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -8, 437, 117. 79 | 24, 824, 525. 69 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -8, 437, 117. 79 | 24, 824, 525. 69 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -8, 437, 117. 79 | 24, 824, 525. 69 |

6.3 净资产变动表

会计主体：太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 800, 000, 028. 70 | - | -287, 984, 032. 25 | 512, 015, 996. 45 |
| 二、本期期初净资产 | 800, 000, 028. 70 | - | -287, 984, 032. 25 | 512, 015, 996. 45 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -10. 32 | - | -8, 437, 113. 87 | -8, 437, 124. 19 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -8, 437, 117. 79 | -8, 437, 117. 79 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 | -10. 32 | - | 3. 92 | -6. 40 |

| | | | | |
|--|----------------------|--------|-----------------|----------------|
| (净资产减少以“-”号填列) | | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | -10.32 | - | 3.92 | -6.40 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 800,000,018.38 | - | -296,421,146.12 | 503,578,872.26 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 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 | 800,000,000.00 | - | -200,526,262.66 | 599,473,737.34 |
| 二、本期期初净资产 | 800,000,000.00 | - | -200,526,262.66 | 599,473,737.34 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | - | - | 24,824,525.69 | 24,824,525.69 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 24,824,525.69 | 24,824,525.69 |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| 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净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - | - |

| | | | | |
|-----------|----------------|---|-----------------|----------------|
| 四、本期期末净资产 | 800,000,000.00 | - | -175,701,736.97 | 624,298,263.03 |
|-----------|----------------|---|-----------------|----------------|

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>曹琦</u> | <u>邓先虎</u> | <u>王瑞瑾</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

太平智行三个月定期开放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[2021]2634号《关于准予太平智行三个月定期开放混合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《太平智行三个月定期开放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 800,000,000.00 元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。经向中国证监会备案,《太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 8 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 800,000,000.00 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 800,000,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债))、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权、国债期货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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产投资占基金资产的比例不低于 60%,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 15 个工作日、开放期及开放期结

束后 15 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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股指期货、国债期货和股票期权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。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+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×40%。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

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重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及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、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 95,904,201.04 |
| 等于：本金 | 95,883,998.33 |
| 加：应计利息 | 20,202.71 |
| 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 | 95,904,201.04 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|----------|----------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 388,243,104.71 | - | 402,288,215.13 | 14,045,110.42 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 4,963.85 | 2,907,218.85 | 66,255.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 4,963.85 | 2,907,218.85 | 66,255.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |

| | | | | |
|----|----------------|----------|----------------|---------------|
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 391,079,104.71 | 4,963.85 | 405,195,433.98 | 14,111,365.42 |

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有任何期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有任何黄金衍生品。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 550,899.62 |
| 其中：交易所市场 | 550,899.62 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提信息披露费 | 179,672.34 |
| 预提审计费 | 17,901.52 |
| 合计 | 748,473.48 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 800,000,028.70 | 800,000,028.70 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -10.32 | -10.32 |
| 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 | 800,000,018.38 | 800,000,018.38 |

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 未分配利润

单位：人民币元

| 目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------|-----------------|----------------|-----------------|
| 上年度末 | -270,914,949.14 | -17,069,083.11 | -287,984,032.25 |
| 本期期初 | -270,914,949.14 | -17,069,083.11 | -287,984,032.25 |
| 本期 | -39,617,567.31 | 31,180,449.52 | -8,437,117.79 |

| | | | |
|----------------|-----------------|---------------|-----------------|
| 利润 | | | |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3.85 | 0.07 | 3.92 |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 金赎回款 | 3.85 | 0.07 | 3.92 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -310,532,512.60 | 14,111,366.48 | -296,421,146.12 |

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 428,961.34 |
| 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 | 12,705.06 |
| 其他 | 1,415.17 |
| 合计 | 443,081.57 |

6.4.7.13 股票投资收益

6.4.7.13.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -40,641,677.85 |
| 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 | -40,641,677.85 |
|----|----------------|

6.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 588,088,820.80 |
| 减：卖出股票成本总额 | 627,321,670.82 |
| 减：交易费用 | 1,408,827.83 |
| 买卖股票差价收入 | -40,641,677.85 |

6.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 6,216.94 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | - |
| 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 | 6,216.94 |

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益买卖债券差价收入。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

6.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益申购差价收入。

6.4.7.16 贵金属投资收益

6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益赎回差价收入。

6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益申购差价收入。

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益其他投资收益。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 3,870,280.43 |
| 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 | 3,870,280.43 |

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | 31,180,449.52 |
| 股票投资 | 31,285,881.82 |
| 债券投资 | -105,432.30 |
| 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 | 31,180,449.52 |

6.4.7.20 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 17,901.52 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 3,947.62 |
| 合计 | 81,521.48 |

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

截至本财务报告报出日，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 |
| 中国农业银行股份有限公司（“农业银行”） | 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 |

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 2024年1月1日至2024年6 月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,719,474.61 | 3,385,682.35 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | - | - |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 2,719,474.61 | 3,385,682.35 |

注：支付基金管理人太平基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.1% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6 月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 494,449.87 | 615,578.65 |

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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固有资金投资本基金的情况

基金管理人于本报告期内及上年度可比期间内未运用固有资金投资本基金。

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 2024年6月30日 | | 上年度末 2023年12月31日 | |
|-------|-------------------|------------------------------|---------------------|------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%) |
| 太平人寿 | 800,000,000.00 | 100.0000 | 800,000,000.00 | 100.0000 |

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 |
| 中国农业银行 | 95,904,201.04 | 428,961.34 | 62,055,901.77 | 248,107.34 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

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（2024 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 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 001359 | 平安电工 | 2024年3月19日 | 6个月 | 锁定期股票 | 17.39 | 20.60 | 184 | 3,199.76 | 3,790.40 | - |
| 001379 | 腾达科技 | 2024年1月11日 | 6个月 | 锁定期股票 | 16.98 | 13.48 | 213 | 3,616.74 | 2,871.24 | - |
| 001387 | 雪祺电气 | 2024年1月4日 | 6个月 | 锁定期股票 | 15.38 | 15.25 | 173 | 2,045.54 | 2,638.25 | - |
| 001389 | 广合科技 | 2024年3月26日 | 6个月 | 锁定期股票 | 17.43 | 34.56 | 222 | 3,869.46 | 7,672.32 | - |
| 301392 | 汇成真空 | 2024年5月28日 | 6个月 | 锁定期股票 | 12.20 | 41.66 | 219 | 2,671.80 | 9,123.54 | - |
| 301502 | 华阳智能 | 2024年1月26日 | 6个月 | 锁定期股票 | 28.01 | 37.83 | 138 | 3,865.38 | 5,220.54 | - |
| 301536 | 星辰科技 | 2024年3月20日 | 6个月 | 锁定期股票 | 16.16 | 32.27 | 481 | 7,772.96 | 15,521.87 | - |
| 301538 | 骏鼎达 | 2024年3月13日 | 6个月 | 锁定期股票 | 55.82 | 91.24 | 149 | 5,972.74 | 13,594.76 | - |
| 301539 | 宏鑫科技 | 2024年4月3日 | 6个月 | 锁定期股票 | 10.64 | 19.82 | 361 | 3,841.04 | 7,155.02 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|-------|--------|--------|-----|-----------|------------|---|
| 301565 | 中仑新材 | 2024年6月13日 | 6个月 | 锁定期股票 | 11.88 | 18.98 | 711 | 8,446.68 | 13,494.78 | - |
| 301587 | 中瑞股份 | 2024年3月27日 | 6个月 | 锁定期股票 | 21.73 | 25.26 | 306 | 6,649.38 | 7,729.56 | - |
| 301588 | 美新科技 | 2024年3月6日 | 6个月 | 锁定期股票 | 14.50 | 21.25 | 257 | 3,726.50 | 5,461.25 | - |
| 301589 | 诺瓦星云 | 2024年2月1日 | 6个月 | 锁定期股票 | 126.89 | 188.01 | 995 | 70,170.17 | 187,069.95 | - |
| 301591 | 肯特股份 | 2024年2月20日 | 6个月 | 锁定期股票 | 19.43 | 36.98 | 219 | 4,255.17 | 8,098.62 | - |
| 601033 | 永兴股份 | 2024年1月11日 | 6个月 | 锁定期股票 | 16.20 | 15.96 | 537 | 8,699.40 | 8,570.52 | - |
| 603082 | 北自科技 | 2024年1月23日 | 6个月 | 锁定期股票 | 21.28 | 29.49 | 107 | 2,276.96 | 3,155.43 | - |
| 603312 | 西典新能 | 2024年1月4日 | 6个月 | 锁定期股票 | 29.02 | 25.36 | 130 | 3,772.60 | 3,296.80 | - |
| 603325 | 博隆技术 | 2024年1月3日 | 6个月 | 锁定期股票 | 72.46 | 68.06 | 66 | 4,782.36 | 4,491.96 | - |
| 603341 | 龙旗科技 | 2024年2月23日 | 6个月 | 锁定期股票 | 26.00 | 37.49 | 218 | 5,668.00 | 8,172.82 | - |
| 603344 | 星德胜 | 2024年3月13日 | 6个月 | 锁定期股票 | 19.18 | 22.66 | 182 | 3,490.76 | 4,124.12 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-----|-------------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| 603350 | 安乃达 | 2024年6月26日 | 1个月 | 新股未上市 | 20.56 | 20.56 | 945 | 19,429.20 | 19,429.20 | - |
| 603350 | 安乃达 | 2024年6月26日 | 6个月 | 新股未上市、锁定期股票 | 20.56 | 20.56 | 106 | 2,179.36 | 2,179.36 | - |
| 603375 | 盛景微 | 2024年1月17日 | 6个月 | 锁定期股票 | 38.18 | 38.90 | 72 | 2,748.96 | 2,800.80 | - |
| 688530 | 欧莱新材 | 2024年4月29日 | 6个月 | 锁定期股票 | 9.60 | 16.10 | 344 | 3,302.40 | 5,538.40 | - |
| 688584 | 上海合晶 | 2024年2月1日 | 6个月 | 锁定期股票 | 22.66 | 15.89 | 591 | 13,392.06 | 9,390.99 | - |
| 688691 | 灿芯股份 | 2024年4月2日 | 6个月 | 锁定期股票 | 19.86 | 42.51 | 247 | 4,905.42 | 10,499.97 | - |
| 688695 | 中创股份 | 2024年3月6日 | 6个月 | 锁定期股票 | 22.43 | 31.55 | 186 | 4,171.98 | 5,868.30 | - |
| 688709 | 成都华微 | 2024年1月31日 | 6个月 | 锁定期股票 | 15.69 | 18.79 | 791 | 12,410.79 | 14,862.89 | - |
| 688717 | 艾罗能源 | 2023年12月26日 | 6个月 | 锁定期股票 | 55.66 | 47.02 | 5,241 | 291,714.06 | 246,431.82 | - |

注：1. 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。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转

让。

3. 基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

本基金本报告期末无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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 年 6 月 30 日，本基金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与风控部，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人，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 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 460,929.11 | 466,030.51 |
| AAA 以下 | 2,446,289.74 | 2,546,765.57 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 2,907,218.85 | 3,012,796.08 |

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 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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(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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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，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 2024 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%。

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 2024 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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|----------------|--------------|------|-----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 95,904,201.04 | - | - | - | 95,904,201.04 |
| 结算备付金 | 762,821.83 | - | - | - | 762,821.83 |
| 存出保证金 | 168,444.68 | - | - | - | 168,444.68 |
| 交易性金融资产 | - | 2,907,218.85 | - | 402,288,215.13 | 405,195,433.98 |
| 应收股利 | - | - | - | 339,441.34 | 339,441.34 |
| 应收清算款 | - | - | - | 3,990,229.07 | 3,990,229.07 |
| 资产总计 | 96,835,467.55 | 2,907,218.85 | - | 406,617,885.54 | 506,360,571.94 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 459,848.93 | 459,848.93 |
| 应付托管费 | - | - | - | 83,608.91 | 83,608.91 |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,489,733.42 | 1,489,733.42 |
| 应交税费 | - | - | - | 34.94 | 34.94 |
| 其他负债 | - | - | - | 748,473.48 | 748,473.48 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,781,699.68 | 2,781,699.68 |
| 利率敏感度缺口 | 96,835,467.55 | 2,907,218.85 | - | -403,836,185.86 | 503,578,872.26 |
| 上年度末 2023年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 132,346,291.24 | - | - | - | 132,346,291.24 |

| | | | | |
|---------|----------------|---|-----------------|----------------|
| 结算备付金 | 902,481.66 | - | - | 902,481.66 |
| 存出保证金 | 182,902.48 | - | - | 182,902.48 |
| 交易性金融资产 | 3,012,796.08 | - | -373,022,839.53 | 376,035,635.61 |
| 应收清算款 | - | - | 3,855,097.76 | 3,855,097.76 |
| 资产总计 | 136,444,471.46 | - | -376,877,937.29 | 513,322,408.75 |
| 负债 | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | 480,522.93 | 480,522.93 |
| 应付托管费 | - | - | 87,367.81 | 87,367.81 |
| 应付清算款 | - | - | 6.24 | 6.24 |
| 应交税费 | - | - | 21.88 | 21.88 |
| 其他负债 | - | - | 498,493.44 | 498,493.44 |
| 负债总计 | - | - | 1,066,412.30 | 1,066,412.30 |
| 利率敏感度缺口 | 136,444,471.46 | - | -375,811,524.99 | 512,255,996.45 |

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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.58%（2023 年 12 月 31 日：0.59%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|--------------|------------------------|---------------|----------------|---------------|
| | 美元 折合人民币 元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的 资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 67,285,051.30 | - | 67,285,051.30 |
| 应收股利 | - | 339,441.34 | - | 339,441.34 |
| 资产合计 | - | 67,624,492.64 | - | 67,624,492.64 |
| 以外币计价的 负债 | | | | |

| | | | | |
|-----------------------|--------------------------|---------------|----------------|---------------|
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外 汇风险敞口净 额 | - | 67,624,492.64 | - | 67,624,492.64 |
| 项目 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | | | |
| | 美元 折合人民 币元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的 资产 | | | | |
| 交易性金融资 产 | - | 28,358,342.46 | - | 28,358,342.46 |
| 资产合计 | - | 28,358,342.46 | - | 28,358,342.46 |
| 以外币计价的 负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外 汇风险敞口净 额 | - | 28,358,342.46 | - | 28,358,342.46 |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| | | | |
|--------------------|--------------------|---------------------------------|---------------------------|
| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量不变 | | |
| 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（2024 年 6 月 30 日） | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
| | 所有外币相对人民 币升值 5% | 3,364,252.57 | 1,417,917.12 |
| 所有外币相对人民 币贬值 5% | -3,364,252.57 | -1,417,917.12 | |

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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0-60%，扣除股指期货合约与股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2024年6月30日 | | 上年度末 2023年12月31日 | |
|---------------|-------------------|-------------------|---------------------|-------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 402,288,215.13 | 79.89 | 373,022,839.53 | 72.85 |
| 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 | 402,288,215.13 | 79.89 | 373,022,839.53 | 72.85 |

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（2024年6月30日） | 上年度末（2023年12月31日） |
| | 沪深 300 指数上升 | 22,057,509.48 | 12,779,839.64 |

| | | | |
|--|-------------|----------------|----------------|
| | 5% | | |
| | 沪深 300 指数下降 | -22,057,509.48 | -12,779,839.64 |
| | 5% | | |

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 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | 404,557,178.50 | 374,958,326.99 |
| 第二层次 | 21,608.56 | 416,670.76 |
| 第三层次 | 616,646.92 | 660,637.86 |
| 合计 | 405,195,433.98 | 376,035,635.61 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 402,288,215.13 | 79.45 |
| | 其中：股票 | 402,288,215.13 | 79.45 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,907,218.85 | 0.57 |
| | 其中：债券 | 2,907,218.85 | 0.57 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 96,667,022.87 | 19.09 |
| 8 | 其他各项资产 | 4,498,115.09 | 0.89 |
| 9 | 合计 | 506,360,571.94 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 22,242,000.00 | 4.42 |
| C | 制造业 | 245,808,257.08 | 48.81 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 33,034,000.00 | 6.56 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,026.60 | 0.00 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 9,949,868.27 | 1.98 |
| J | 金融业 | 8,130,000.00 | 1.61 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,419.12 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,735,486.24 | 0.94 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 8,570.52 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 11,085,536.00 | 2.20 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 335,003,163.83 | 66.52 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 原材料 | - | - |
| 非日常生活消费品 | 22,214,631.20 | 4.41 |
| 日常消费品 | 2,092,318.90 | 0.42 |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 通信服务 | 25,491,152.40 | 5.06 |
| 公用事业 | 17,486,948.80 | 3.47 |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 67,285,051.30 | 13.36 |

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 | 002050 | 三花智控 | 1,400,000 | 26,712,000.00 | 5.30 |
| 2 | 00700 | 腾讯控股 | 75,000 | 25,491,152.40 | 5.06 |
| 3 | 601138 | 工业富联 | 849,900 | 23,287,260.00 | 4.62 |
| 4 | 002463 | 沪电股份 | 500,000 | 18,250,000.00 | 3.62 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 12,000 | 17,608,680.00 | 3.50 |
| 6 | 00836 | 华润电力 | 800,000 | 17,486,948.80 | 3.47 |
| 7 | 600900 | 长江电力 | 500,000 | 14,460,000.00 | 2.87 |
| 8 | 300308 | 中际旭创 | 100,000 | 13,788,000.00 | 2.74 |
| 9 | 300502 | 新易盛 | 119,947 | 12,660,405.85 | 2.51 |
| 10 | 000725 | 京东方 A | 3,000,000 | 12,270,000.00 | 2.44 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 11 | 000526 | 学大教育 | 179,960 | 11,085,536.00 | 2.20 |
| 12 | 000596 | 古井贡酒 | 50,000 | 10,553,500.00 | 2.10 |
| 13 | 601899 | 紫金矿业 | 600,000 | 10,542,000.00 | 2.09 |
| 14 | 300760 | 迈瑞医疗 | 35,000 | 10,181,850.00 | 2.02 |
| 15 | 03690 | 美团-W | 100,000 | 10,139,874.80 | 2.01 |
| 16 | 688256 | 寒武纪 | 50,000 | 9,933,500.00 | 1.97 |
| 17 | 000338 | 潍柴动力 | 600,000 | 9,744,000.00 | 1.93 |
| 18 | 300014 | 亿纬锂能 | 230,000 | 9,181,600.00 | 1.82 |
| 19 | 603583 | 捷昌驱动 | 450,000 | 9,171,000.00 | 1.82 |
| 20 | 000100 | TCL 科技 | 2,000,000 | 8,640,000.00 | 1.72 |
| 21 | 601211 | 国泰君安 | 600,000 | 8,130,000.00 | 1.61 |
| 22 | 600886 | 国投电力 | 400,000 | 7,296,000.00 | 1.45 |
| 23 | 000977 | 浪潮信息 | 200,000 | 7,274,000.00 | 1.44 |
| 24 | 01070 | TCL 电子 | 1,200,000 | 6,921,765.12 | 1.37 |
| 25 | 600938 | 中国海油 | 200,000 | 6,600,000.00 | 1.31 |
| 26 | 600025 | 华能水电 | 600,000 | 6,468,000.00 | 1.28 |
| 27 | 600584 | 长电科技 | 200,000 | 6,342,000.00 | 1.26 |
| 28 | 603009 | 北特科技 | 350,000 | 6,275,500.00 | 1.25 |
| 29 | 300274 | 阳光电源 | 99,920 | 6,198,037.60 | 1.23 |
| 30 | 300408 | 三环集团 | 200,000 | 5,838,000.00 | 1.16 |
| 31 | 603993 | 洛阳钼业 | 600,000 | 5,100,000.00 | 1.01 |
| 32 | 600011 | 华能国际 | 500,000 | 4,810,000.00 | 0.96 |
| 33 | 002967 | 广电计量 | 400,000 | 4,720,000.00 | 0.94 |
| 34 | 002422 | 科伦药业 | 150,000 | 4,549,500.00 | 0.90 |
| 35 | 603197 | 保隆科技 | 140,000 | 4,410,000.00 | 0.88 |
| 36 | 002223 | 鱼跃医疗 | 100,000 | 3,760,000.00 | 0.75 |
| 37 | 09992 | 泡泡玛特 | 100,000 | 3,491,001.00 | 0.69 |
| 38 | 002126 | 银轮股份 | 200,000 | 3,482,000.00 | 0.69 |
| 39 | 300258 | 精锻科技 | 349,906 | 2,844,735.78 | 0.56 |
| 40 | 688235 | 百济神州 | 23,022 | 2,666,868.48 | 0.53 |
| 41 | 603766 | 隆鑫通用 | 391,200 | 2,652,336.00 | 0.53 |
| 42 | 300638 | 广和通 | 150,000 | 2,565,000.00 | 0.51 |
| 43 | 603283 | 赛腾股份 | 30,000 | 2,292,000.00 | 0.46 |
| 44 | 02367 | 巨子生物 | 50,000 | 2,092,318.90 | 0.42 |
| 45 | 300763 | 锦浪科技 | 40,000 | 1,665,600.00 | 0.33 |
| 46 | 00425 | 敏实集团 | 150,000 | 1,661,990.28 | 0.33 |
| 47 | 688717 | 艾罗能源 | 5,241 | 246,431.82 | 0.05 |
| 48 | 301589 | 诺瓦星云 | 995 | 187,069.95 | 0.04 |
| 49 | 301565 | 中仑新材 | 7,103 | 174,381.42 | 0.03 |
| 50 | 301526 | 国际复材 | 7,881 | 26,243.73 | 0.01 |
| 51 | 301498 | 乖宝宠物 | 461 | 24,801.80 | 0.00 |
| 52 | 688472 | 阿特斯 | 2,289 | 23,302.02 | 0.00 |
| 53 | 603350 | 安乃达 | 1,051 | 21,608.56 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 54 | 603296 | 华勤技术 | 300 | 16,569.00 | 0.00 |
| 55 | 301536 | 星辰科技 | 481 | 15,521.87 | 0.00 |
| 56 | 301508 | 中机认检 | 419 | 15,486.24 | 0.00 |
| 57 | 688709 | 成都华微 | 791 | 14,862.89 | 0.00 |
| 58 | 688652 | 京仪装备 | 376 | 14,697.84 | 0.00 |
| 59 | 301538 | 骏鼎达 | 149 | 13,594.76 | 0.00 |
| 60 | 688691 | 灿芯股份 | 247 | 10,499.97 | 0.00 |
| 61 | 688584 | 上海合晶 | 591 | 9,390.99 | 0.00 |
| 62 | 301392 | 汇成真空 | 219 | 9,123.54 | 0.00 |
| 63 | 601033 | 永兴股份 | 537 | 8,570.52 | 0.00 |
| 64 | 688653 | 康希通信 | 648 | 8,346.24 | 0.00 |
| 65 | 301459 | 丰茂股份 | 208 | 8,259.68 | 0.00 |
| 66 | 603341 | 龙旗科技 | 218 | 8,172.82 | 0.00 |
| 67 | 301591 | 肯特股份 | 219 | 8,098.62 | 0.00 |
| 68 | 301568 | 思泰克 | 246 | 7,827.72 | 0.00 |
| 69 | 301587 | 中瑞股份 | 306 | 7,729.56 | 0.00 |
| 70 | 001389 | 广合科技 | 222 | 7,672.32 | 0.00 |
| 71 | 301539 | 宏鑫科技 | 361 | 7,155.02 | 0.00 |
| 72 | 601083 | 锦江航运 | 735 | 7,026.60 | 0.00 |
| 73 | 688720 | 艾森股份 | 165 | 6,689.10 | 0.00 |
| 74 | 301349 | 信德新材 | 231 | 6,384.84 | 0.00 |
| 75 | 301555 | 惠柏新材 | 224 | 6,345.92 | 0.00 |
| 76 | 301578 | 辰奕智能 | 153 | 6,054.21 | 0.00 |
| 77 | 688695 | 中创股份 | 186 | 5,868.30 | 0.00 |
| 78 | 688530 | 欧莱新材 | 344 | 5,538.40 | 0.00 |
| 79 | 301588 | 美新科技 | 257 | 5,461.25 | 0.00 |
| 80 | 301502 | 华阳智能 | 138 | 5,220.54 | 0.00 |
| 81 | 001378 | 德冠新材 | 205 | 4,891.30 | 0.00 |
| 82 | 603107 | 上海汽配 | 292 | 4,639.88 | 0.00 |
| 83 | 603325 | 博隆技术 | 66 | 4,491.96 | 0.00 |
| 84 | 603344 | 星德胜 | 182 | 4,124.12 | 0.00 |
| 85 | 001359 | 平安电工 | 184 | 3,790.40 | 0.00 |
| 86 | 603312 | 西典新能 | 130 | 3,296.80 | 0.00 |
| 87 | 603082 | 北自科技 | 107 | 3,155.43 | 0.00 |
| 88 | 001379 | 腾达科技 | 213 | 2,871.24 | 0.00 |
| 89 | 603375 | 盛景微 | 72 | 2,800.80 | 0.00 |
| 90 | 001387 | 雪祺电气 | 173 | 2,638.25 | 0.00 |
| 91 | 001239 | 永达股份 | 189 | 2,623.32 | 0.00 |
| 92 | 001358 | 兴欣新材 | 122 | 2,503.44 | 0.00 |
| 93 | 603373 | 安邦护卫 | 88 | 2,419.12 | 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 | 002050 | 三花智控 | 33,777,142.18 | 6.60 |
| 2 | 601138 | 工业富联 | 25,081,864.00 | 4.90 |
| 3 | 000596 | 古井贡酒 | 24,799,230.00 | 4.84 |
| 4 | 600872 | 中炬高新 | 18,443,110.00 | 3.60 |
| 5 | 688256 | 寒武纪 | 17,597,738.29 | 3.44 |
| 6 | 300502 | 新易盛 | 17,110,222.65 | 3.34 |
| 7 | 00836 | 华润电力 | 17,037,784.94 | 3.33 |
| 8 | 00700 | 腾讯控股 | 16,966,985.39 | 3.31 |
| 9 | 300308 | 中际旭创 | 16,074,812.00 | 3.14 |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 12,665,315.18 | 2.47 |
| 11 | 000977 | 浪潮信息 | 12,589,816.00 | 2.46 |
| 12 | 000725 | 京东方 A | 12,010,000.00 | 2.35 |
| 13 | 603009 | 北特科技 | 11,943,080.00 | 2.33 |
| 14 | 600584 | 长电科技 | 11,771,520.00 | 2.30 |
| 15 | 000625 | 长安汽车 | 11,581,633.00 | 2.26 |
| 16 | 03690 | 美团-W | 11,554,062.50 | 2.26 |
| 17 | 300394 | 天孚通信 | 11,143,706.00 | 2.18 |
| 18 | 601899 | 紫金矿业 | 10,406,315.00 | 2.03 |
| 19 | 600418 | 江淮汽车 | 10,075,102.00 | 1.97 |
| 20 | 000526 | 学大教育 | 9,725,798.00 | 1.90 |

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 | 600872 | 中炬高新 | 32,856,821.00 | 6.42 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 28,619,196.00 | 5.59 |
| 3 | 002463 | 沪电股份 | 20,675,966.00 | 4.04 |
| 4 | 300258 | 精锻科技 | 19,653,214.38 | 3.84 |
| 5 | 000625 | 长安汽车 | 19,280,448.50 | 3.77 |
| 6 | 300308 | 中际旭创 | 15,371,540.20 | 3.00 |
| 7 | 300502 | 新易盛 | 13,830,332.00 | 2.70 |
| 8 | 000596 | 古井贡酒 | 13,719,177.00 | 2.68 |
| 9 | 600200 | 江苏吴中 | 13,239,293.00 | 2.59 |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 12,874,609.00 | 2.51 |
| 11 | 688012 | 中微公司 | 12,321,409.49 | 2.41 |
| 12 | 300394 | 天孚通信 | 12,203,282.93 | 2.38 |
| 13 | 000568 | 泸州老窖 | 11,940,684.00 | 2.33 |
| 14 | 002050 | 三花智控 | 11,206,340.00 | 2.19 |
| 15 | 688169 | 石头科技 | 10,914,221.43 | 2.13 |
| 16 | 000858 | 五粮液 | 10,857,189.00 | 2.12 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 688256 | 寒武纪 | 10,373,110.98 | 2.03 |
| 18 | 600048 | 保利发展 | 9,909,000.00 | 1.94 |
| 19 | 600418 | 江淮汽车 | 9,804,440.11 | 1.91 |
| 20 | 600867 | 通化东宝 | 8,333,450.00 | 1.63 |

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 | 625,301,164.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 588,088,820.80 |

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 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,907,218.85 | 0.58 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,907,218.85 | 0.58 |

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 | 127089 | 晶澳转债 | 10,820 | 1,052,813.57 | 0.21 |
| 2 | 113059 | 福莱转债 | 8,250 | 881,199.45 | 0.17 |
| 3 | 113053 | 隆 22 转债 | 4,530 | 460,929.11 | 0.09 |
| 4 | 113061 | 拓普转债 | 2,720 | 322,860.20 | 0.06 |
| 5 | 118031 | 天 23 转债 | 2,040 | 189,416.52 | 0.04 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

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

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。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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 | 168,444.68 |
| 2 | 应收清算款 | 3,990,229.07 |
| 3 | 应收股利 | 339,441.34 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 4,498,115.09 |
|---|----|--------------|

7.12.4 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 | 127089 | 晶澳转债 | 1,052,813.57 | 0.21 |
| 2 | 113059 | 福莱转债 | 881,199.45 | 0.17 |
| 3 | 113053 | 隆 22 转债 | 460,929.11 | 0.09 |
| 4 | 113061 | 拓普转债 | 322,860.20 | 0.06 |
| 5 | 118031 | 天 23 转债 | 189,416.52 | 0.04 |

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在前十名股票中存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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 (%) |
| 16 | 50,000,001.15 | 800,000,018.38 | 100.0000 | - | - |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

注:报告期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理均未持有本基金。

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 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | 800,000,000.00 | 100.00 | 800,000,000.00 | 100.00 | 3 年 |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 800,000,000.00 | 100.00 | 800,000,000.00 | 100.00 | 3 年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2021 年 8 月 25 日） 基金份额总额 | 800,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 800,000,028.70 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 10.32 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 800,000,018.38 |

§ 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、基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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 (%) | |
| 光大证券 | 1 | 426,465,562.35 | 35.19 | 322,615.29 | 35.58 | - |
| 国泰君安证券 | 1 | 361,041,448.85 | 29.79 | 265,690.72 | 29.30 | - |
| 中信建投证券 | 1 | 260,838,745.41 | 21.52 | 197,457.20 | 21.77 | - |
| 中泰证券 | 1 | 137,302,433.45 | 11.33 | 101,041.48 | 11.14 | - |
| 西部证券 | 2 | 24,778,321.30 | 2.04 | 18,904.65 | 2.08 | - |
| 德邦证券 | 1 | 1,508,231.31 | 0.12 | 1,125.02 | 0.12 | - |

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) 公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定。最近一年未出现亏损或审计机构无法出具无保留意见的审计报告等情形；

(2) 经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到监管部门处罚；

(3) 合规风控能力较强。内部管理规范、严格，具备健全的内控和风险控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。最近一年证监会对证券公司分类结果为 BB 类以上（含）；

(4) 交易服务能力较强。具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易

的需要。重点参考最近一个年度券商交易量市场排名；

(5) 研究服务能力较强。设置固定的研究机构，拥有专业的研究人员，能够及时全面地提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他信息服务等。

(6) 与公司签订综合服务协议。

基金管理人的总经理办公会根据上述标准确定可以合作的券商名单，由投资决策委员会在上述名单内确定租用的交易单元，并签订交易单元租用协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

报告期内未新增交易单元。

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 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 1 月 22 日 |
| 2 | 关于太平智行三个月定期开放混合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 | 2024 年 2 月 8 日 |
| 3 | 太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 3 月 30 日 |
| 4 | 太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新） | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 4 月 20 日 |

| | | | |
|---|--|-----------|-----------------|
| | (2024 年第 1 号) | | |
| 5 | 太平智行三个月定期开放混合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 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 6 | 太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金 2024 年第一季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 7 | 关于太平智行三个月定期开放混合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 | 2024 年 6 月 14 日 |
| 8 | 太平智行三个月定期开放混合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 | 2024 年 6 月 28 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 | 20240101—20240630 | 800,000,000.00 | - | 800,000,000.00 | - | 100.0000 |

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、《太平智行三个月定期开放混合发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平智行三个月定期开放混合发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平智行三个月定期开放混合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，503A）

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

2024 年 8 月 30 日