

太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证
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：上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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	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	8
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	9
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	37
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	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	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	45
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
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	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	47
§ 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	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 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	太平嘉和三个月定期开债券发起式
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	4,628,569,375.13 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	57,940,210.29
本期利润	35,054,946.14
加权平均基金份额本期利润	0.0075
本期加权平均净值利润率	0.75%
本期基金份额净值增长率	0.75%
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	48,584,072.31
期末可供分配基金份额利润	0.0105
期末基金资产净值	4,677,153,447.44
期末基金份额净值	1.0105
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	1.05%

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

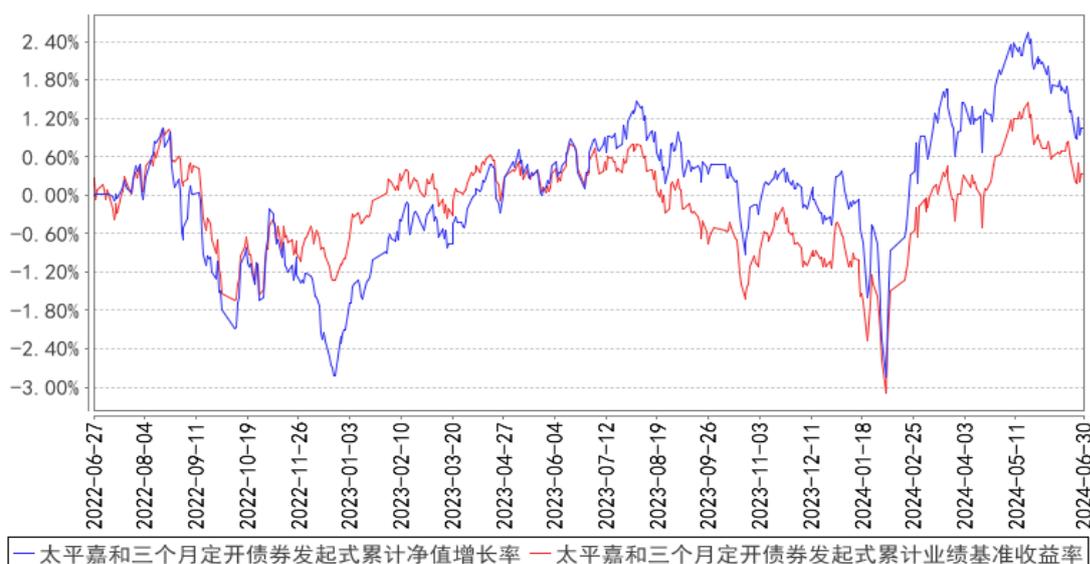
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.01%	0.18%	-0.41%	0.15%	-0.60%	0.03%

过去三个月	0.05%	0.21%	0.30%	0.17%	-0.25%	0.04%
过去六个月	0.75%	0.27%	0.75%	0.22%	0.00%	0.05%
过去一年	0.39%	0.22%	-0.22%	0.18%	0.61%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.05%	0.20%	0.32%	0.17%	0.73%	0.03%

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

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：本基金基金合同生效日为 2022 年 6 月 27 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		
张子权	本基金的基金经理	2022 年 6 月 27 日	-	7 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	-	12 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。
赵鑫淼	本基金的基金经理助理	2023 年 1 月 13 日	-	5 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《证券投资基金经营机构董事、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 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

本报告期内，国内宏观经济仍处在疫后修复的固本培元期，资金面整体宽松，债券收益率持续下行至年内低点，整条收益率曲线呈现牛陡走势，各品种利差水平亦压缩至历史低位。展望 2024 年下半年，央行多次警示长债收益率风险，以及逆周期政策的不断推出，债券收益率整体或仍处于底部宽幅区间震荡，向上大幅突破的可能性较低。本管理人主要使用信用债进行底仓配置，并积极参与波段机会。本管理人根据市场情况将用中长久期置换短久期信用债持仓，并希望通过长端国债和银行次级债的波段交易，以在控制波动的同时获取债市阶段性收益。

本报告期内，权益市场呈现震荡下行格局。主要宽基指数在市值维度上出现了明显的分化，代表大市值的上证 50 和沪深 300 分别上涨 2.95% 和 0.89% 而代表中盘的中证 500 下跌了 -8.95%，代表小盘的中证 1000 和中证 2000 则分别下跌了 -16.84% 和 -23.28%。本产品二季度在股票上获取了一定的超额收益，对冲了部分权益市场下行的不利影响。

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 0.75%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

据统计局数据，2024 年上半年 GDP 增速 5%，二季度增速为 4.7%；统计局新闻发言人总结为‘形有波动、势仍向好’，短期波动不会改变长期向好大势。上半年整体 GDP 增速还在年初政府工作报告定下的“5%左右”目标区间，但是二季度数据略显疲态。我们认为，二季度疲弱的 GDP 数据不能简单的线性外推，主要基于以下两点：一是金融数据“挤水分”可能部分推动了经济数据“挤水分”；二是整改“手工补息”政策为代表的监管政策将防止资金空转和防风险工作的重要性提高，二季度金融稳定目标的地位可能阶段性超过经济增长。那接下来，如果 2024 年全年 GDP 增速要实现 5%，则下半年增速需要达到 5.1%，假设年初政府工作报告下的“5%左右”的目标不变，那下半年政策明显还有发力的空间，数据可能会更具弹性。此外，宏观经济数据表现的相对良好，与微观层面居民就业收入以及企业经营有温差，所以后续出台政策强化支持的概率也更大。市场对于经济疲弱时政策会加码从而推动经济升温的期盼。

我们认为，市场的悲观情绪可能并未完全考虑到宏观经济的基本面因素。当前，尽管面临一些挑战，但国内经济的韧性和长期增长潜力依然存在。此外，政策层面的支持也在不断加强，为市场提供了稳定的基础。

展望下半年，我们对权益市场的表现持相对乐观的态度。随着市场情绪的逐步回暖和投资者对新规影响的深入理解，我们预计权益资产的估值将得到合理的修复。此外，我们也将密切关注行业发展趋势和宏观经济指标，以便更好地把握投资机会。

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：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	1,443,394.50	10,855,053.54
结算备付金		44,614.86	44,275.47
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,171,301,176.27	5,233,750,928.23
其中：股票投资		833,753,970.91	891,075,363.01
基金投资		-	-

债券投资		4,337,547,205.36	4,342,675,565.22
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	32,000,000.00	34,997,048.09
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		1,568,000.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		5,206,357,185.63	5,279,647,305.33
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		527,166,463.89	594,987,782.22
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,356,164.67	1,386,157.09
应付托管费		309,980.50	316,835.92
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		244,975.56	319,809.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	126,153.57	208,787.19
负债合计		529,203,738.19	597,219,371.96
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,628,569,375.13	4,668,557,111.99
未分配利润	6.4.7.11	48,584,072.31	13,870,821.38
净资产合计		4,677,153,447.44	4,682,427,933.37
负债和净资产总计		5,206,357,185.63	5,279,647,305.33

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0105 元，基金份额总额 4,628,569,375.13 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：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		51,176,033.78	90,560,352.87
1. 利息收入		396,436.26	456,786.14
其中：存款利息收入	6.4.7.12	13,652.72	58,333.15
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		382,783.54	398,452.99
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		73,664,861.67	59,166,449.83
其中：股票投资收益	6.4.7.13	7,814,666.16	17,073,948.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	54,936,890.56	34,231,945.75
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	10,913,304.95	7,860,555.65
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-22,885,264.15	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）	6.4.7.20	-	-
减：二、营业总支出		16,121,087.64	9,075,372.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,180,035.29	5,359,089.03
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,869,722.37	1,224,934.59
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,797,262.93	2,291,777.42
其中：卖出回购金融资产支出		5,797,262.93	2,291,777.42
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-

7. 税金及附加		167,345.81	99,514.72
8. 其他费用	6.4.7.22	106,721.24	100,057.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,054,946.14	81,484,980.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,054,946.14	81,484,980.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		35,054,946.14	81,484,980.08

6.3 净资产变动表

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：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	4,668,557,111.99	-	13,870,821.38	4,682,427,933.37
二、本期期初净资产	4,668,557,111.99	-	13,870,821.38	4,682,427,933.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-39,987,736.86	-	34,713,250.93	-5,274,485.93
（一）、综合收益总额	-	-	35,054,946.14	35,054,946.14
（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）	-39,987,736.86	-	-341,695.21	-40,329,432.07
其中：1. 基金申购款	983.47	-	16.03	999.50
2. 基金赎回款	-39,988,720.33	-	-341,711.24	-40,330,431.57
（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	4,628,569,375. 13	-	48,584,072.31	4,677,153,447.4 4
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	2,960,791,943. 03	-	-62,317,982.90	2,898,473,960.1 3
二、本期期初净资产	2,960,791,943. 03	-	-62,317,982.90	2,898,473,960.1 3
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,627,484,757. 60	-	92,385,909.45	1,719,870,667.0 5
(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净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	1,627,484,757. 60	-	10,900,929.37	1,638,385,686.9 7
其中：1. 基金申购款	1,627,489,756. 10	-	10,900,910.49	1,638,390,666.5 9
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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,588,276,700. 63	-	30,067,926.55	4,618,344,627.1 8

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：

曹琦

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》注册,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。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 2,899,998,000.00 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 2024 年 06 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[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	459,680.63
等于：本金	458,827.95
加：应计利息	852.68
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	983,713.87
等于：本金	983,623.95
加：应计利息	89.92
减：坏账准备	-
合计	1,443,394.50

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	890,367,055.14	-	833,753,970.91	-56,613,084.23	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	363,282,127.42	4,147,869.08	368,157,280.38	727,283.88
	银行间市场	3,900,032,566.24	56,538,924.98	3,969,389,924.98	12,818,433.76
	合计	4,263,314,693.66	60,686,794.06	4,337,547,205.36	13,545,717.64
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	5,153,681,748.80	60,686,794.06	5,171,301,176.27	-43,067,366.59	

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 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	32,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	32,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本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 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	27,073.95
其中：交易所市场	-
银行间市场	27,073.95
应付利息	-
预提信息披露费	59,672.34
预提审计费	26,852.28
其他	12,555.00
合计	126,153.57

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	4,668,557,111.99	4,668,557,111.99
本期申购	983.47	983.47
本期赎回（以“-”号填列）	-39,988,720.33	-39,988,720.33
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	4,628,569,375.13	4,628,569,375.13

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

	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

目			
上年度末	43,048,336.96	-29,177,515.58	13,870,821.38
本期期初	43,048,336.96	-29,177,515.58	13,870,821.38
本期利润	57,940,210.29	-22,885,264.15	35,054,946.14
本期基金份额交易产生的变动数	-715,297.87	373,602.66	-341,695.21
其中：基金申购款	23.03	-7.00	16.03
金赎回款	-715,320.90	373,609.66	-341,711.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	100,273,249.38	-51,689,177.07	48,584,072.31

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	7,989.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,324.23
结算备付金利息收入	339.39
其他	-
合计	13,652.72

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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	7,814,666.16
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	7,814,666.16

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	4,723,562,807.86
减：卖出股票成本总额	4,705,892,454.50
减：交易费用	9,855,687.20
买卖股票差价收入	7,814,666.16

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.14 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	59,014,508.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,077,617.44
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	54,936,890.56

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	762,678,818.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	754,442,304.74

本总额	
减：应计利息总额	12,281,122.74
减：交易费用	33,008.36
买卖债券差价收入	-4,077,617.44

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 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

本基金在本报告期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。

6.4.7.15.3 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。

6.4.7.15.4 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

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

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。

6.4.7.16.3 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。

6.4.7.16.4 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。

6.4.7.17 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

本基金在本报告期无衍生工具收益—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

本基金在本报告期无衍生工具收益—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	10,913,304.95
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	10,913,304.95

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	-22,885,264.15
股票投资	-49,116,415.57
债券投资	26,231,151.42
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	-22,885,264.15

6.4.7.20 其他收入

本基金在本报告期无其他收入。

6.4.7.21 信用减值损失

本基金于本报告期无信用减值损失。

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	26,852.28
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,584.62
账户维护费	18,612.00
合计	106,721.24

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均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均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均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均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均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	8,180,035.29	5,359,089.03

其中：应支付销售机构的客户维护费	71.77	173.46
应支付基金管理人的净管理费	8,179,963.52	5,358,915.57

注：支付基金管理人太平基金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 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	1,869,722.37	1,224,934.59

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：

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

6.4.10.3 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均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均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均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 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	4,367,972,180.73	94.3698	4,367,972,180.73	93.5615

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
上海银行	459,680.63	7,989.10	3,431,121.65	24,188.75

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均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

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 474,166,516.89 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
092280065	22 工行二 级资本债 03A	2024 年 7 月 1 日	105.25	400,000	42,100,721.10
1428011	14 建行二 级 01	2024 年 7 月 1 日	105.73	143,000	15,118,902.40

190409	19 农发 09	2024 年 7 月 1 日	103.07	175,000	18,037,336.07
2128051	21 工商银行二级 02	2024 年 7 月 1 日	105.16	300,000	31,549,111.48
230211	23 国开 11	2024 年 7 月 1 日	101.60	1,300,000	132,078,508.20
102100768	21 广州城投 MTN001	2024 年 7 月 4 日	101.22	1,000,000	101,216,630.14
102101830	21 诚通控股 MTN004A	2024 年 7 月 4 日	102.90	43,000	4,424,640.32
190409	19 农发 09	2024 年 7 月 4 日	103.07	820,000	84,517,803.28
2128032	21 兴业银行二级 01	2024 年 7 月 4 日	106.48	800,000	85,184,188.49
230302	23 进出 02	2024 年 7 月 4 日	100.89	20,000	2,017,852.05
合计				5,001,000	516,245,693.53

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 52,999,947.00 元, 截至 2024 年 07 月 05 日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 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，将风险控制可在承受的范围之内。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	132,078,508.20	132,615,166.67
合计	132,078,508.20	132,615,166.67

注：短期未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.2.2 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	2, 197, 641, 870. 59	2, 117, 120, 438. 34
AAA 以下	11, 274, 534. 66	24, 237, 466. 38
未评级	1, 996, 552, 291. 91	2, 068, 702, 493. 83
合计	4, 205, 468, 697. 16	4, 210, 060, 398. 55

注：长期未评级债券为国债、政策性金融债、中期票据。

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，除卖出回购金融资产款余额中有人民币 527, 166, 463. 89 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(所有者权益)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

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结算备用金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

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	1,443,394.50	-	-	-	1,443,394.50
结算备付金	44,614.86	-	-	-	44,614.86
交易性金融资产	2,362,246,431.07	1,544,687,985.15	430,612,789.14	833,753,970.91	5,171,301,176.27
买入返售金融资产	32,000,000.00	-	-	-	32,000,000.00
应收清算款	-	-	-	1,568,000.00	1,568,000.00
资产总计	2,395,734,440.43	1,544,687,985.15	430,612,789.14	835,321,970.91	5,206,357,185.63
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,356,164.67	1,356,164.67
应付托管费	-	-	-	309,980.50	309,980.50
卖出回购金融资产款	527,166,463.89	-	-	-	527,166,463.89
应交税费	-	-	-	244,975.56	244,975.56
其他负债	-	-	-	126,153.57	126,153.57
负债总计	527,166,463.89	-	-	2,037,274.30	529,203,738.19
利率敏感度缺口	1,868,567,976.54	1,544,687,985.15	430,612,789.14	833,284,696.61	4,677,153,447.44
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	10,855,053.54	-	-	-	10,855,053.54
结算备付金	44,275.47	-	-	-	44,275.47
交易性金融资产	1,797,549,989.60	2,539,643,605.09	5,481,970.53	891,075,363.01	5,233,750,928.23
买入返售金融资产	34,997,048.09	-	-	-	34,997,048.09
资产总计	1,843,446,366.70	2,539,643,605.09	5,481,970.53	891,075,363.01	5,279,647,305.33
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,386,157.09	1,386,157.09
应付托管费	-	-	-	316,835.92	316,835.92
卖出回购金融资产款	594,987,782.22	-	-	-	594,987,782.22
应交税费	-	-	-	319,809.54	319,809.54
其他负债	-	-	-	208,787.19	208,787.19
负债总计	594,987,782.22	-	-	2,231,589.74	597,219,371.96
利率敏感度缺口	1,248,458,584.48	2,539,643,605.09	5,481,970.53	888,843,773.27	4,682,427,933.37

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	4,774,807.54	18,610,579.61
	2. 市场利率上升 25 个基点	-4,747,674.36	-18,425,952.17

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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资产占基金资产的0%-20%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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	833,753,970.91	17.83	891,075,363.01	19.03
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	833,753,970.91	17.83	891,075,363.01	19.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 17.83%(2023 年 12 月 31 日：19.03%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.4 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	857,620,845.25	916,768,595.57
第二层次	4,313,680,331.02	4,316,982,332.66
第三层次	-	-
合计	5,171,301,176.27	5,233,750,928.23

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(上期末：同)。

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	833,753,970.91	16.01
	其中：股票	833,753,970.91	16.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,337,547,205.36	83.31
	其中：债券	4,337,547,205.36	83.31
	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	32,000,000.00	0.61
	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	1,488,009.36	0.03
8	其他各项资产	1,568,000.00	0.03
9	合计	5,206,357,185.63	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	2,022,648.00	0.04
B	采矿业	46,586,127.00	1.00
C	制造业	501,494,118.42	10.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,646,946.20	0.83
E	建筑业	16,578,180.00	0.35
F	批发和零售业	32,260,913.84	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	27,665,748.00	0.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,245,861.91	0.88
J	金融业	95,088,041.54	2.03
K	房地产业	13,511,145.00	0.29
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,942,126.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	4,104,066.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,608,049.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	833,753,970.91	17.83

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	9,300	13,646,727.00	0.29
2	300502	新易盛	87,800	9,267,290.00	0.20
3	601077	渝农商行	1,636,817	8,216,821.34	0.18
4	000725	京东方 A	1,923,200	7,865,888.00	0.17
5	600548	深高速	719,600	7,649,348.00	0.16
6	601138	工业富联	276,200	7,567,880.00	0.16
7	000738	航发控制	368,200	7,389,774.00	0.16
8	300136	信维通信	368,800	7,221,104.00	0.15
9	600348	华阳股份	695,200	6,924,192.00	0.15

10	600219	南山铝业	1,788,600	6,814,566.00	0.15
11	600025	华能水电	627,600	6,765,528.00	0.14
12	000027	深圳能源	909,400	6,638,620.00	0.14
13	600801	华新水泥	478,390	6,577,862.50	0.14
14	688122	西部超导	170,570	6,536,242.40	0.14
15	601991	大唐发电	2,141,400	6,445,614.00	0.14
16	600549	厦门钨业	372,600	6,427,350.00	0.14
17	603893	瑞芯微	108,600	6,425,862.00	0.14
18	601666	平煤股份	569,000	6,372,800.00	0.14
19	000932	华菱钢铁	1,431,600	6,341,988.00	0.14
20	601211	国泰君安	466,100	6,315,655.00	0.14
21	601818	光大银行	1,991,400	6,312,738.00	0.13
22	600602	云赛智联	561,900	6,203,376.00	0.13
23	601186	中国铁建	723,500	6,200,395.00	0.13
24	600893	航发动力	169,303	6,188,024.65	0.13
25	002185	华天科技	758,198	6,179,313.70	0.13
26	601717	郑煤机	413,000	6,112,400.00	0.13
27	603993	洛阳钼业	703,500	5,979,750.00	0.13
28	002507	涪陵榨菜	485,500	5,947,375.00	0.13
29	600517	国网英大	1,368,250	5,924,522.50	0.13
30	601319	中国人保	1,137,462	5,857,929.30	0.13
31	000728	国元证券	966,500	5,856,990.00	0.13
32	600098	广州发展	905,100	5,792,640.00	0.12
33	601857	中国石油	559,800	5,777,136.00	0.12
34	600835	上海机电	501,100	5,767,661.00	0.12
35	601369	陕鼓动力	717,600	5,755,152.00	0.12
36	002777	久远银海	382,600	5,735,174.00	0.12
37	002128	电投能源	271,500	5,728,650.00	0.12
38	600315	上海家化	321,500	5,716,270.00	0.12
39	603053	成都燃气	589,500	5,694,570.00	0.12
40	601811	新华文轩	406,300	5,692,263.00	0.12
41	600618	氯碱化工	647,300	5,683,294.00	0.12
42	688128	中国电研	326,864	5,625,329.44	0.12
43	300595	欧普康视	358,300	5,618,144.00	0.12
44	603658	安图生物	121,800	5,611,326.00	0.12
45	002287	奇正藏药	284,144	5,563,539.52	0.12
46	002461	珠江啤酒	749,600	5,562,032.00	0.12
47	600566	济川药业	175,000	5,549,250.00	0.12
48	600460	士兰微	316,300	5,538,413.00	0.12
49	601877	正泰电器	289,600	5,519,776.00	0.12
50	002100	天康生物	791,600	5,485,788.00	0.12
51	000783	长江证券	1,133,500	5,474,805.00	0.12
52	603680	今创集团	829,400	5,474,040.00	0.12

53	002948	青岛银行	1,605,800	5,411,546.00	0.12
54	000810	创维数字	629,458	5,400,749.64	0.12
55	601231	环旭电子	335,800	5,389,590.00	0.12
56	688055	龙腾光电	1,686,244	5,345,393.48	0.11
57	601512	中新集团	697,100	5,311,902.00	0.11
58	600050	中国联通	1,125,000	5,287,500.00	0.11
59	000636	风华高科	401,700	5,246,202.00	0.11
60	603939	益丰药房	212,736	5,222,668.80	0.11
61	601169	北京银行	888,185	5,187,000.40	0.11
62	002120	韵达股份	667,700	5,167,998.00	0.11
63	002705	新宝股份	367,000	5,163,690.00	0.11
64	600985	淮北矿业	304,100	5,090,634.00	0.11
65	600582	天地科技	726,104	5,002,856.56	0.11
66	601658	邮储银行	985,100	4,994,457.00	0.11
67	000553	安道麦 A	1,099,400	4,991,276.00	0.11
68	605339	南侨食品	348,700	4,958,514.00	0.11
69	601390	中国中铁	751,300	4,898,476.00	0.10
70	600989	宝丰能源	280,000	4,852,400.00	0.10
71	600588	用友网络	483,000	4,830,000.00	0.10
72	300750	宁德时代	26,500	4,770,795.00	0.10
73	002531	天顺风能	532,800	4,763,232.00	0.10
74	601688	华泰证券	383,500	4,751,565.00	0.10
75	688036	传音控股	61,336	4,694,657.44	0.10
76	001872	招商港口	239,700	4,614,225.00	0.10
77	300782	卓胜微	59,316	4,611,225.84	0.10
78	000513	丽珠集团	123,416	4,592,309.36	0.10
79	600015	华夏银行	713,700	4,567,680.00	0.10
80	603233	大参林	319,240	4,565,132.00	0.10
81	002378	章源钨业	793,220	4,553,082.80	0.10
82	002563	森马服饰	783,000	4,549,230.00	0.10
83	000651	格力电器	115,700	4,537,754.00	0.10
84	002601	龙佰集团	244,000	4,531,080.00	0.10
85	601228	广州港	1,480,500	4,515,525.00	0.10
86	300142	沃森生物	395,166	4,496,989.08	0.10
87	000408	藏格矿业	186,800	4,496,276.00	0.10
88	603019	中科曙光	107,600	4,465,400.00	0.10
89	000157	中联重科	578,400	4,442,112.00	0.09
90	002399	海普瑞	508,500	4,408,695.00	0.09
91	000999	华润三九	103,400	4,402,772.00	0.09
92	000930	中粮科技	874,900	4,400,747.00	0.09
93	002678	珠江钢琴	1,206,300	4,366,806.00	0.09
94	600570	恒生电子	246,800	4,358,488.00	0.09
95	300182	捷成股份	1,168,100	4,333,651.00	0.09

96	601618	中国中冶	1,397,000	4,330,700.00	0.09
97	600161	天坛生物	177,000	4,318,800.00	0.09
98	603883	老百姓	234,780	4,310,560.80	0.09
99	000963	华东医药	154,300	4,291,083.00	0.09
100	600559	老白干酒	235,500	4,281,390.00	0.09
101	002240	盛新锂能	318,100	4,268,902.00	0.09
102	300919	中伟股份	137,560	4,262,984.40	0.09
103	603511	爱慕股份	345,700	4,245,196.00	0.09
104	600981	汇鸿集团	2,501,600	4,227,704.00	0.09
105	600612	老凤祥	72,400	4,212,956.00	0.09
106	300741	华宝股份	276,000	4,206,240.00	0.09
107	605099	共创草坪	222,200	4,201,802.00	0.09
108	601336	新华保险	138,600	4,162,158.00	0.09
109	688469	芯联集成	1,048,661	4,152,697.56	0.09
110	600933	爱柯迪	280,500	4,148,595.00	0.09
111	605222	起帆电缆	269,660	4,136,584.40	0.09
112	000712	锦龙股份	549,500	4,121,250.00	0.09
113	002007	华兰生物	260,100	4,106,979.00	0.09
114	601827	三峰环境	483,400	4,104,066.00	0.09
115	603728	鸣志电器	102,000	4,103,460.00	0.09
116	601398	工商银行	715,700	4,079,490.00	0.09
117	601865	福莱特	202,400	4,068,240.00	0.09
118	600998	九州通	817,623	3,990,000.24	0.09
119	601139	深圳燃气	594,700	3,972,596.00	0.08
120	688586	江航装备	425,374	3,955,978.20	0.08
121	601965	中国汽研	233,400	3,942,126.00	0.08
122	601155	新城控股	440,400	3,906,348.00	0.08
123	002436	兴森科技	362,800	3,744,096.00	0.08
124	300045	华力创通	210,300	3,711,795.00	0.08
125	000933	神火股份	178,900	3,619,147.00	0.08
126	600580	卧龙电驱	292,700	3,556,305.00	0.08
127	603195	公牛集团	45,595	3,516,286.40	0.08
128	000039	中集集团	377,500	3,495,650.00	0.07
129	603698	航天工程	291,247	3,486,226.59	0.07
130	002534	西子洁能	345,200	3,455,452.00	0.07
131	605005	合兴股份	215,700	3,442,572.00	0.07
132	002153	石基信息	598,510	3,429,462.30	0.07
133	002978	安宁股份	121,200	3,376,632.00	0.07
134	601016	节能风电	1,116,180	3,337,378.20	0.07
135	002237	恒邦股份	288,300	3,318,333.00	0.07
136	002643	万润股份	323,600	3,236,000.00	0.07
137	600828	茂业商业	1,358,000	3,218,460.00	0.07
138	600085	同仁堂	82,100	3,137,041.00	0.07

139	601808	中海油服	179,200	3,082,240.00	0.07
140	600926	杭州银行	233,000	3,040,650.00	0.07
141	000987	越秀资本	606,800	3,009,728.00	0.06
142	600183	生益科技	133,600	2,813,616.00	0.06
143	002945	华林证券	272,500	2,719,550.00	0.06
144	002036	联创电子	394,700	2,664,225.00	0.06
145	603486	科沃斯	56,400	2,660,952.00	0.06
146	600812	华北制药	638,500	2,630,620.00	0.06
147	601003	柳钢股份	1,038,200	2,626,646.00	0.06
148	603915	国茂股份	254,900	2,622,921.00	0.06
149	002950	奥美医疗	383,400	2,530,440.00	0.05
150	600346	恒力石化	181,000	2,524,950.00	0.05
151	603585	苏利股份	251,100	2,450,736.00	0.05
152	601988	中国银行	501,500	2,316,930.00	0.05
153	601168	西部矿业	126,700	2,274,265.00	0.05
154	002268	电科网安	159,500	2,269,685.00	0.05
155	001979	招商蛇口	251,300	2,208,927.00	0.05
156	600764	中国海防	112,100	2,200,523.00	0.05
157	688111	金山办公	9,640	2,193,100.00	0.05
158	601665	齐鲁银行	445,400	2,186,914.00	0.05
159	002430	杭氧股份	97,500	2,169,375.00	0.05
160	600160	巨化股份	89,700	2,164,461.00	0.05
161	600916	中国黄金	224,900	2,163,538.00	0.05
162	002558	巨人网络	228,083	2,153,103.52	0.05
163	002901	大博医疗	81,100	2,094,813.00	0.04
164	000517	荣安地产	777,600	2,083,968.00	0.04
165	603235	天新药业	85,582	2,056,535.46	0.04
166	002271	东方雨虹	165,300	2,039,802.00	0.04
167	603515	欧普照明	117,320	2,034,328.80	0.04
168	600467	好当家	1,424,400	2,022,648.00	0.04
169	600640	国脉文化	195,200	2,020,320.00	0.04
170	603501	韦尔股份	19,900	1,977,463.00	0.04
171	600779	水井坊	52,200	1,964,286.00	0.04
172	603305	旭升集团	178,300	1,882,848.00	0.04
173	603806	福斯特	120,240	1,767,528.00	0.04
174	603256	宏和科技	248,500	1,754,410.00	0.04
175	600584	长电科技	53,200	1,686,972.00	0.04
176	000505	京粮控股	307,300	1,671,712.00	0.04
177	000761	本钢板材	662,400	1,662,624.00	0.04
178	002444	巨星科技	67,000	1,654,900.00	0.04
179	002384	东山精密	79,300	1,641,510.00	0.04
180	002466	天齐锂业	54,300	1,624,113.00	0.03
181	600623	华谊集团	279,100	1,613,198.00	0.03

182	002340	格林美	253,200	1,612,884.00	0.03
183	601872	招商轮船	188,300	1,591,135.00	0.03
184	603766	隆鑫通用	215,100	1,458,378.00	0.03
185	001965	招商公路	120,700	1,431,502.00	0.03
186	002821	凯莱英	21,700	1,427,860.00	0.03
187	603345	安井食品	19,000	1,411,890.00	0.03
188	002212	天融信	286,900	1,397,203.00	0.03
189	601326	秦港股份	417,100	1,322,207.00	0.03
190	002241	歌尔股份	64,000	1,248,640.00	0.03
191	000625	长安汽车	85,800	1,152,294.00	0.02
192	601668	中国建筑	211,500	1,123,065.00	0.02
193	688521	芯原股份	37,743	1,009,625.25	0.02
194	601898	中煤能源	80,400	1,003,392.00	0.02
195	600851	海欣股份	212,000	968,840.00	0.02
196	600676	交运股份	321,600	890,832.00	0.02
197	001256	炜冈科技	64,000	878,080.00	0.02
198	688234	天岳先进	18,129	850,612.68	0.02
199	601058	赛轮轮胎	58,900	824,600.00	0.02
200	300821	东岳硅材	117,100	800,964.00	0.02
201	002426	胜利精密	470,000	742,600.00	0.02
202	605008	长鸿高科	56,210	736,351.00	0.02
203	603112	华翔股份	68,000	714,680.00	0.02
204	600760	中航沈飞	16,200	649,620.00	0.01
205	605033	美邦股份	51,000	633,420.00	0.01
206	601958	金钼股份	59,500	619,395.00	0.01
207	601949	中国出版	98,500	582,135.00	0.01
208	601162	天风证券	265,900	579,662.00	0.01
209	600429	三元股份	147,900	551,667.00	0.01
210	601866	中远海发	187,200	482,976.00	0.01
211	300223	北京君正	7,900	437,976.00	0.01
212	601700	风范股份	95,100	417,489.00	0.01
213	603155	新亚强	37,187	407,569.52	0.01
214	600096	云天化	20,400	396,168.00	0.01
215	688130	晶华微	11,819	358,824.84	0.01
216	601069	西部黄金	30,700	357,041.00	0.01
217	603897	长城科技	19,600	343,980.00	0.01
218	600038	中直股份	7,800	320,658.00	0.01
219	600335	国机汽车	47,100	271,767.00	0.01
220	002636	金安国纪	38,400	243,840.00	0.01
221	002429	兆驰股份	28,100	135,161.00	0.00
222	600600	青岛啤酒	1,500	109,155.00	0.00
223	601117	中国化学	3,100	25,544.00	0.00
224	600841	动力新科	5,000	16,400.00	0.00

225	603385	惠达卫浴	2,300	12,627.00	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	600519	贵州茅台	36,690,719.24	0.78
2	000039	中集集团	31,504,970.00	0.67
3	002705	新宝股份	28,031,444.00	0.60
4	601298	青岛港	25,827,499.40	0.55
5	601369	陕鼓动力	24,591,164.00	0.53
6	601336	新华保险	24,418,083.00	0.52
7	601077	渝农商行	23,999,415.88	0.51
8	601126	四方股份	23,299,022.14	0.50
9	600015	华夏银行	22,933,926.60	0.49
10	600348	华阳股份	22,666,945.00	0.48
11	603986	兆易创新	22,447,129.27	0.48
12	601991	大唐发电	22,409,478.46	0.48
13	601857	中国石油	22,096,035.00	0.47
14	000997	新大陆	21,977,596.00	0.47
15	601577	长沙银行	21,804,428.00	0.47
16	600418	江淮汽车	21,372,560.00	0.46
17	002384	东山精密	21,233,974.00	0.45
18	000728	国元证券	21,034,872.00	0.45
19	000630	铜陵有色	20,923,911.00	0.45
20	002025	航天电器	20,689,618.93	0.44

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	600519	贵州茅台	36,610,236.00	0.78
2	000630	铜陵有色	30,442,199.00	0.65
3	000039	中集集团	30,225,523.38	0.65
4	601577	长沙银行	29,272,638.47	0.63
5	002705	新宝股份	28,683,984.64	0.61
6	601336	新华保险	27,827,652.00	0.59
7	600489	中金黄金	27,819,327.87	0.59
8	002025	航天电器	27,425,633.85	0.59
9	601857	中国石油	26,398,538.00	0.56
10	601298	青岛港	26,283,012.40	0.56
11	600348	华阳股份	24,955,423.50	0.53

12	601126	四方股份	23,611,597.16	0.50
13	600875	东方电气	23,587,053.00	0.50
14	603986	兆易创新	23,305,590.92	0.50
15	002027	分众传媒	23,142,536.00	0.49
16	002384	东山精密	23,091,123.00	0.49
17	600418	江淮汽车	21,921,600.66	0.47
18	601688	华泰证券	21,768,059.52	0.46
19	601600	中国铝业	21,711,005.00	0.46
20	600795	国电电力	21,626,647.00	0.46

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	4,697,687,477.97
卖出股票收入（成交）总额	4,723,562,807.86

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	931,823,572.70	19.92
	其中：政策性金融债	245,238,260.27	5.24
4	企业债券	140,115,482.75	3.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,241,741,275.57	69.31
7	可转债（可交换债）	23,866,874.34	0.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,337,547,205.36	92.74

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	182,229,928.77	3.90
2	230211	23 国开 11	1,300,000	132,078,508.20	2.82
3	190409	19 农发 09	1,000,000	103,070,491.80	2.20
4	102281841	22 中电投 MTN025	1,000,000	102,653,803.28	2.19
5	102281860	22 苏交通	1,000,000	102,628,382.51	2.19

		MTN005			
--	--	--------	--	--	--

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出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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的备选股票库的情形。

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	-
2	应收清算款	1,568,000.00
3	应收股利	-
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	1,568,000.00

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	123226	中富转债	1,362,538.43	0.03
2	128048	张行转债	1,314,151.23	0.03
3	110059	浦发转债	1,300,146.61	0.03
4	113052	兴业转债	1,296,447.70	0.03
5	127084	柳工转 2	1,296,201.11	0.03
6	113056	重银转债	1,295,002.59	0.03
7	113024	核建转债	1,269,119.52	0.03
8	123121	帝尔转债	1,259,886.49	0.03
9	127085	韵达转债	1,257,353.58	0.03
10	127032	苏行转债	1,257,030.14	0.03
11	113065	齐鲁转债	1,253,973.78	0.03
12	123078	飞凯转债	1,228,231.78	0.03
13	113043	财通转债	1,222,704.25	0.03
14	113641	华友转债	1,220,648.17	0.03
15	113044	大秦转债	1,202,650.96	0.03
16	113062	常银转债	1,199,063.02	0.03
17	123115	捷捷转债	968,936.64	0.02
18	127034	绿茵转债	646,137.39	0.01
19	113662	豪能转债	626,755.62	0.01
20	113672	福蓉转债	550,019.99	0.01
21	123100	朗科转债	402,175.61	0.01
22	123090	三诺转债	390,182.92	0.01
23	127055	精装转债	47,516.81	0.00

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	户均持有的基金	持有人结构
-------	---------	-------

(户)	份额	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	308,571,291.68	4,628,337,470.66	99.9950	231,904.47	0.0050

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	65,452.28	0.0014

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	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	55,446.76	0.0012	-	-	-
基金经理等人员	99.85	0.0000	-	-	-
基金管理人股东	4,367,972,180.73	94.3698	2,899,998,000.00	62.6543	3年
其他	9,905.67	0.0002	-	-	-
合计	4,368,037,633.01	94.3712	2,899,998,000.00	62.6543	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	4,668,557,111.99
本报告期基金总申购份额	983.47
减：本报告期基金总赎回份额	39,988,720.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,628,569,375.13

§ 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

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	9,421,250,285.83	100.00	6,903,934.39	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) 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控制度，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。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

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	410,003,497.39	100.00	5,510,812,000.00	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	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加招商银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 18 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 2023 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
3	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	2024 年 2 月 2 日
4	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 13 日

	售机构并参加其费率优惠的公告		
5	太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 30 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）（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2024 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
8	太平嘉和三个月定期开放债券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
9	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	2024 年 6 月 11 日
10	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	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	4,367,972,180.73	-	-	4,367,972,180.73	94.3698
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，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