

太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证 券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 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	10
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	12
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 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	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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53

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	53
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.11 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	太平嘉和三个月定开债券发起式
基金主代码	015959
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 27 日
基金管理人	太平基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,311,236,189.47 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@bosc.cn
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	上海市黄浦区中山南路 688 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、5 楼 503A	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码		200120	200120
法定代表人		刘冬	顾建忠

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	283,620,122.47
本期利润	312,925,800.82
加权平均基金份额本期利润	0.0537
本期加权平均净值利润率	4.69%
本期基金份额净值增长率	4.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,246,904,941.45
期末可供分配基金份额利润	0.1705
期末基金资产净值	8,558,141,130.92
期末基金份额净值	1.1705
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	17.05%

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

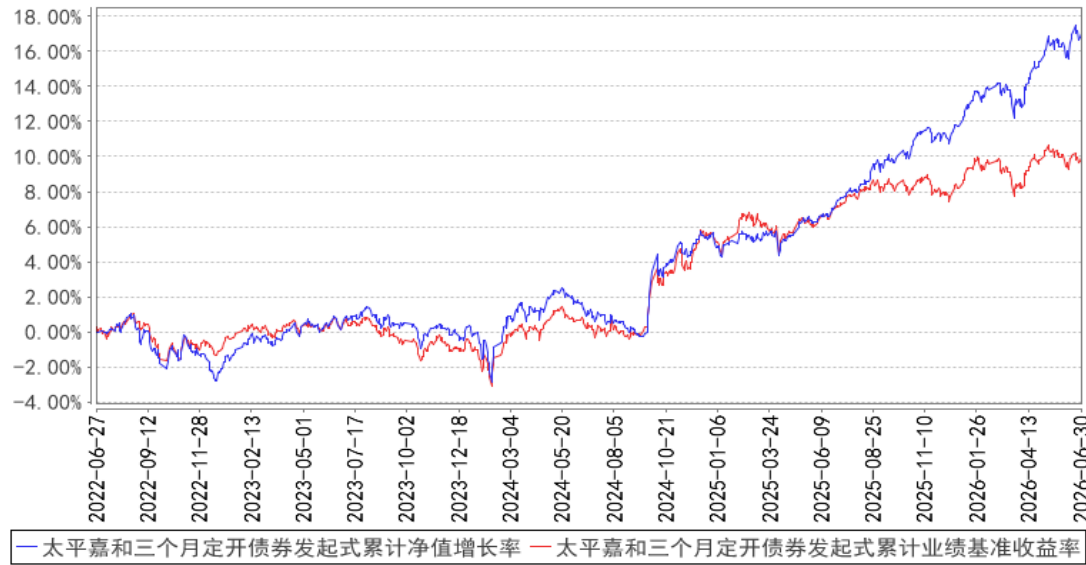
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	3.69%	0.26%	1.61%	0.20%	2.08%	0.06%
过去六个月	4.76%	0.25%	1.65%	0.21%	3.11%	0.04%

过去一年	9.24%	0.20%	2.69%	0.18%	6.55%	0.02%
过去三年	16.28%	0.22%	9.36%	0.20%	6.92%	0.02%
自基金合同生效起至今	17.05%	0.21%	9.95%	0.19%	7.10%	0.02%

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

太平嘉和三个月定开债券发起式累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2022 年 06 月 27 日，本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立，2016 年 8 月 22 日更名为太平基金管理有限公司。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学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 47 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	—	9 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。2024 年 10 月 29 日起担任太平量化选股混合型证券投资基金基金经理。2025 年 1 月 24 日起担任太平中证红利指数型证券投资基金基金经理。2025 年 4 月 29 日起担任太平中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 23 日起担任太平嘉裕债券型证券投资基金基金经理。2026 年 4 月 21 日起担任太平中证港股通互联网指数型证券投资基金基金经理。
韩聪	多元资产投资部助理总监、本基金的基金经理	2022 年 8 月 1 日	—	14 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，现任多元资产投资部助理总监。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。2025 年 9 月 23 日起担任太平嘉裕债券型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

第 8 页 共 59 页

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，国内债市整体震荡偏强、呈现窄幅波动的特征。国内内需修复偏弱，央行坚持稳健货币政策，银行间流动性维持合理充裕，资产荒持续支撑机构配置需求，10 年期国债收益率中枢震荡下移，最低收于 1.71%。外部扰动持续存在，美伊地缘冲突推升油价，美联储政策前景高度不确定，美债收益率围绕 4.5% 反复波动，叠加中美利差约束，限制国内长端利率下行空间。市场阶段性博弈输入性通胀预期、海外政策预期切换，行情多为波段走势。6 月资金面边际收敛，交易盘止盈带动债市小幅回调。短端受益于宽松资金表现优于长端，收益率曲线趋于陡峭；信用债整体平稳，信用利差持续压缩。展望下半年，仍预计经济缓慢修复、流动性继续维持中性偏松，债市整体难有单边行情，票息收益的确定性仍更为重要。本管理人将采用“中性久期债券骑乘滚动”的交易策略，避免在超长端利率债的交易中过度博弈。

本报告期内，权益市场呈现分化格局。主要宽基指数在行业维度上出现显著分化，代表科技成长的科创 50 和创业板指分别上涨 64.25% 和 35.58%，而代表传统蓝筹的上证 50 和沪深 300 则分别下跌 -1.38% 和上涨 7.55%。本产品权益部分以指数增强策略为核心，投资风格偏向大盘成长、

大盘价值和红利，在科技行情主导的结构性分化环境中，依托均衡配置持续积累超额收益，表现稳健。后续管理人将根据市场风格变化情况，动态应变，持续深耕 Alpha 策略，力争为组合贡献稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 4.76%，同期业绩比较基准收益率为 1.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我国经济长期向好的基本面没有改变，高质量发展扎实推进，新质生产力加快培育，宏观政策有望继续保持连续性、稳定性、针对性，为经济运行营造适宜的货币金融环境。随着稳增长政策效应逐步显现，企业盈利有望稳步改善，市场内在稳定性持续增强。证券市场方面，资本市场基础制度不断完善，中长期资金入市步伐加快，市场投资功能与融资功能协调发展，市场韧性进一步提升。行业层面，科技创新、高端制造、绿色低碳等领域在产业政策支持下具备良好发展前景，部分传统行业在供需格局优化中亦蕴含结构性机会。总体而言，我国资本市场长期投资价值逐步显现。基金管理人将继续秉持长期投资理念，坚持深入研究、精选标的，在有效控制风险的前提下，努力捕捉市场结构性机会，力争为基金份额持有人创造长期稳健的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、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，本基金未实施利润分配。

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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	23,385,601.45	359,665,647.00
结算备付金		45,549.46	45,355.79
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	8,675,572,497.63	7,253,725,606.92
其中：股票投资		1,393,158,306.80	1,020,150,903.29
基金投资		—	—
债券投资		7,282,414,190.83	6,233,574,703.63
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	600,025,361.64	-87,396.78
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		20,074,034.48	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		9,319,103,044.66	7,613,349,212.93
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		757,209,633.14	1,212,251,564.88
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,045,359.00	-
应付管理人报酬		1,965,775.90	1,894,892.80
应付托管费		449,320.21	433,118.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		92,058.60	79,452.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	199,766.89	244,247.31
负债合计		760,961,913.74	1,214,903,275.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	7,311,236,189.47	5,726,474,245.60
未分配利润	6.4.7.11	1,246,904,941.45	671,971,691.80
净资产合计		8,558,141,130.92	6,398,445,937.40
负债和净资产总计		9,319,103,044.66	7,613,349,212.93

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1705 元，基金份额总额 7,311,236,189.47 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		334,117,174.38	114,189,915.91
1. 利息收入		396,135.59	526,690.52
其中：存款利息收入	6.4.7.12	65,682.54	37,272.15
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		330,453.05	489,418.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		304,415,326.78	111,420,990.02
其中：股票投资收益	6.4.7.13	220,073,925.92	30,433,496.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	78,241,042.81	63,892,126.44
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	6,100,358.05	17,095,366.79
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	29,305,678.35	2,242,113.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	33.66	122.15
减：二、营业总支出		21,191,373.56	16,963,891.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,593,581.91	9,590,944.78
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,649,961.60	2,192,215.96
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,784,567.15	4,993,428.73
其中：卖出回购金融资产支出		6,784,567.15	4,993,428.73
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		52,528.01	84,347.41
8. 其他费用	6.4.7.22	110,734.89	102,954.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		312,925,800.82	97,226,024.32

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		312,925,800.82	97,226,024.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		312,925,800.82	97,226,024.32

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,726,474,245.60	671,971,691.80	6,398,445,937.40
二、本期期初净资产	5,726,474,245.60	671,971,691.80	6,398,445,937.40
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	1,584,761,943.87	574,933,249.65	2,159,695,193.52
（一）、综合收益总额	-	312,925,800.82	312,925,800.82
（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）	1,584,761,943.87	262,007,448.83	1,846,769,392.70
其中：1. 基金申购款	1,844,788,945.09	303,017,502.45	2,147,806,447.54
2. 基金赎回款	-260,027,001.22	-41,010,053.62	-301,037,054.84
（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	7,311,236,189.47	1,246,904,941.45	8,558,141,130.92
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,527,983,892.82	246,035,777.61	4,774,019,670.43
二、本期期初净资产	4,527,983,892.82	246,035,777.61	4,774,019,670.43

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	1,017,320,358.92	150,209,947.35	1,167,530,306.27
(一)、综合收益总额	-	97,226,024.32	97,226,024.32
(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)	1,017,320,358.92	52,983,923.03	1,070,304,281.95
其中: 1. 基金申购款	1,017,375,016.08	52,987,326.99	1,070,362,343.07
2. 基金赎回款	-54,657.16	-3,403.96	-58,061.12
(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	5,545,304,251.74	396,245,724.96	5,941,549,976.70

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:

熊莹

史彦刚

王瑞瑾

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)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

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

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》（以下合称“企业会计准则”）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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金于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

本基金于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

本基金于本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国

债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对证券投资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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)取得的股息红利所得，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。

d)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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,989,468.33
等于：本金	1,987,966.22
加：应计利息	1,502.11
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	21,396,133.12
等于：本金	21,394,262.44
加：应计利息	1,870.68
减：坏账准备	-
合计	23,385,601.45

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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,367,422,288.38	-	1,393,158,306.80	25,736,018.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	80,448,121.42	380,113.75	80,801,213.75	-27,021.42
	银行间市场	7,154,345,593.84	75,644,977.08	7,201,612,977.08	-28,377,593.84
	合计	7,234,793,715.26	76,025,090.83	7,282,414,190.83	-28,404,615.26
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		8,602,216,003.64	76,025,090.83	8,675,572,497.63	-2,668,596.84

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

本基金于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

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场		70,000,000.00	-
银行间市场		530,025,361.64	-

合计	600,025,361.64	-
----	----------------	---

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 2026 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	81,109.74
其中：交易所市场	-
银行间市场	81,109.74
应付利息	-

其他	29,397.00
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	29,752.78
合计	199,766.89

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,726,474,245.60	5,726,474,245.60
本期申购	1,844,788,945.09	1,844,788,945.09
本期赎回（以“-”号填列）	-260,027,001.22	-260,027,001.22
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	7,311,236,189.47	7,311,236,189.47

注：申购含红利再投、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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	715,233,117.28	-43,261,425.48	671,971,691.80
本期期初	715,233,117.28	-43,261,425.48	671,971,691.80
本期利润	283,620,122.47	29,305,678.35	312,925,800.82
本期基金份额交易产生的变动数	269,960,295.07	-7,952,846.24	262,007,448.83
其中：基金申购款	311,529,290.23	-8,511,787.78	303,017,502.45
基金赎回款	-41,568,995.16	558,941.54	-41,010,053.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,268,813,534.82	-21,908,593.37	1,246,904,941.45

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	21,824.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	43,664.59
结算备付金利息收入	193.67
其他	-
合计	65,682.54

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	220,073,925.92
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	220,073,925.92

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	6,021,148,133.54
减：卖出股票成本总额	5,791,850,248.68
减：交易费用	9,223,958.94
买卖股票差价收入	220,073,925.92

6.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金于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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	84,885,255.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,644,212.96
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	78,241,042.81

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 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	653,362,175.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	648,349,819.31
减：应计利息总额	11,646,295.71
减：交易费用	10,272.99
买卖债券差价收入	-6,644,212.96

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,100,358.05
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	6,100,358.05

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	29,305,678.35
股票投资	3,866,277.60
债券投资	25,439,400.75
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	29,305,678.35

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	33.66
合计	33.66

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.21 信用减值损失

本基金于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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,874.74
账户维护费	18,600.00
合计	110,734.89

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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、注册登记机构
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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,593,581.91	9,590,944.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	239,825.32	20,390.22
应支付基金管理人的净管理费	11,353,756.59	9,570,554.56

注：支付基金管理人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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,649,961.60	2,192,215.96

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

本基金于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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	6,603,316,762.82	90.3174	5,318,631,939.26	92.8780

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

6.4.10.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	1,989,468.33	21,824.28	3,074,578.92	19,035.83

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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于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

本基金于本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 07 月 13 日	890.99	2,451	2,074,257.68	2,155,728.03	-

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 2026 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 757,209,633.14 元，是以如下债券作为抵押：

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
102681262	26 泸州窖 MTN001	2026 年 7 月 1 日	100.63	600,000	60,375,928.77
102681264	26 浙江机场 MTN001	2026 年 7 月 1 日	100.25	551,000	55,238,338.74
2228003	22 兴业银行二级 01	2026 年 7 月 1 日	102.62	1,900,000	194,978,676.71
2228041	22 农业银行二级 01	2026 年 7 月 1 日	101.97	206,000	21,004,916.99
092280069	22 华夏银行二级资本债 01	2026 年 7 月 2 日	104.43	1,474,000	153,924,368.21
092280080	22 光大银行二级资本债 01A	2026 年 7 月 2 日	104.41	1,843,000	192,426,014.22
232480039	24 广发银行二级资本债 01A	2026 年 7 月 2 日	103.38	1,464,000	151,347,638.14
合计				8,038,000	829,295,881.78

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2026 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

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于证券投资基金中较低预期风险/收益的产品。本基金投资的金融工具主要包括具有良好流动性的固定收益类品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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于信用良好的银行，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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	150,314,246.57	191,321,841.64
合计	150,314,246.57	191,321,841.64

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	4,585,706,969.31	4,465,236,341.41
AAA 以下	-	188,107.15
未评级	2,546,392,974.95	1,576,828,413.43
合计	7,132,099,944.26	6,042,252,861.99

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、长期未评级债券为国债、政策性金融债、中期票据、企业债。

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于约定开放日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于约定开放期内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。

于本期末，本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金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报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。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%。于本期末，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。于本期末，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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金于本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	23,385,601.45	-	-	-	23,385,601.45
结算备付金	45,549.46	-	-	-	45,549.46
交易性金融资产	650,790,457.52	1,816,496,123.83	4,815,127,609.48	1,393,158,306.80	8,675,572,497.63
买入返售金融资产	600,025,361.64	-	-	-	600,025,361.64
应收申购款	-	-	-	20,074,034.48	20,074,034.48
资产总计	1,274,246,970.07	1,816,496,123.83	4,815,127,609.48	1,413,232,341.28	9,319,103,044.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,045,359.00	1,045,359.00
应付管理人报酬	-	-	-	1,965,775.90	1,965,775.90
应付托管费	-	-	-	449,320.21	449,320.21
卖出回购金融资产款	757,209,633.14	-	-	-	757,209,633.14
应交税费	-	-	-	92,058.60	92,058.60
其他负债	-	-	-	199,766.89	199,766.89
负债总计	757,209,633.14	-	-	3,752,280.60	760,961,913.74
利率敏感度缺口	517,037,336.93	1,816,496,123.83	4,815,127,609.48	1,409,480,060.68	8,558,141,130.92
上年度末 2025 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	359,665,647.00	-	-	-	359,665,647.00
结算备付金	45,355.79	-	-	-	45,355.79

交易性金融资产	854,422,772.92	537,806,206.02	4,841,345,724.69	1,020,150,903.29	7,253,725,606.92
买入返售金融资产	-87,396.78	-	-	-	-87,396.78
资产总计	1,214,046,378.93	537,806,206.02	4,841,345,724.69	1,020,150,903.29	7,613,349,212.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,894,892.80	1,894,892.80
应付托管费	-	-	-	433,118.36	433,118.36
卖出回购金融资产款	1,212,251,564.88	-	-	-	1,212,251,564.88
应交税费	-	-	-	79,452.18	79,452.18
其他负债	-	-	-	244,247.31	244,247.31
负债总计	1,212,251,564.88	-	-	2,651,710.65	1,214,903,275.53
利率敏感度缺口	1,794,814.05	537,806,206.02	4,841,345,724.69	1,017,499,192.64	6,398,445,937.40

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

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	122,044,147.79	99,029,261.83
	2. 市场利率上升 25 个基点	-117,354,707.45	-96,107,269.19

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	1,393,158,306.80	16.28	1,020,150,903.29	15.94
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	1,393,158,306.80	16.28	1,020,150,903.29	15.94

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 06 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 16.28%(2025 年 12 月 31 日：15.94%)，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（2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,391,002,578.77	1,016,042,449.44
第二层次	7,284,569,918.86	6,237,683,157.48
第三层次	—	—
合计	8,675,572,497.63	7,253,725,606.92

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025 年 12 月 31 日：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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 06 月 30 日，本基金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	1,393,158,306.80	14.95
	其中：股票	1,393,158,306.80	14.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,282,414,190.83	78.15
	其中：债券	7,282,414,190.83	78.15
	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	600,025,361.64	6.44
	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	23,431,150.91	0.25
8	其他各项资产	20,074,034.48	0.22
9	合计	9,319,103,044.66	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	3,800,629.00	0.04
B	采矿业	68,754,043.84	0.80
C	制造业	1,052,336,689.78	12.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,859,123.00	0.19
E	建筑业	11,868,822.00	0.14
F	批发和零售业	27,070,895.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	12,121,459.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	106,346,814.13	1.24
J	金融业	36,129,003.00	0.42
K	房地产业	8,479,116.00	0.10
L	租赁和商务服务业	4,668,170.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	17,570,044.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	11,927,635.05	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,540,991.00	0.05

Q	卫生和社会工作	8,078,851.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	3,606,021.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	1,393,158,306.80	16.28

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	300308	中际旭创	33,600	42,672,000.00	0.50
2	300502	新易盛	51,804	31,445,028.00	0.37
3	300750	宁德时代	59,500	23,384,095.00	0.27
4	688256	寒武纪	13,909	22,192,504.95	0.26
5	000333	美的集团	185,300	13,995,709.00	0.16
6	688498	源杰科技	7,409	13,973,374.00	0.16
7	002475	立讯精密	183,110	12,890,944.00	0.15
8	601899	紫金矿业	498,458	12,531,234.12	0.15
9	603986	兆易创新	15,200	12,388,000.00	0.14
10	688012	中微公司	24,836	11,635,666.00	0.14
11	688041	海光信息	30,311	11,224,163.30	0.13
12	002384	东山精密	39,300	10,310,355.00	0.12
13	688766	普冉股份	12,063	9,247,495.80	0.11
14	600519	贵州茅台	7,800	9,246,822.00	0.11
15	688525	佰维存储	18,457	9,131,231.61	0.11
16	601138	工业富联	114,000	8,225,100.00	0.10
17	300476	胜宏科技	21,900	7,586,817.00	0.09
18	688981	中芯国际	47,084	7,477,880.88	0.09
19	601318	中国平安	155,300	7,414,022.00	0.09
20	002080	中材科技	75,700	6,813,000.00	0.08
21	603993	洛阳钼业	388,000	6,809,400.00	0.08
22	600487	亨通光电	61,000	6,669,740.00	0.08
23	002353	杰瑞股份	40,700	6,206,750.00	0.07
24	000338	潍柴动力	223,900	6,101,275.00	0.07
25	002738	中矿资源	99,300	5,857,707.00	0.07
26	002463	沪电股份	37,690	5,759,032.00	0.07
27	600426	华鲁恒升	240,200	5,745,584.00	0.07
28	600919	江苏银行	526,000	5,670,280.00	0.07
29	688025	杰普特	12,054	5,665,380.00	0.07
30	002028	思源电气	32,111	5,555,203.00	0.06
31	600549	厦门钨业	64,700	5,512,440.00	0.06
32	002602	世纪华通	372,800	5,256,480.00	0.06

33	002851	麦格米特	31,000	5,182,580.00	0.06
34	600938	中国海油	189,700	5,150,355.00	0.06
35	600989	宝丰能源	252,000	5,123,160.00	0.06
36	603799	华友钴业	105,200	5,076,952.00	0.06
37	002532	天山铝业	465,917	4,999,289.41	0.06
38	601231	环旭电子	153,800	4,983,120.00	0.06
39	002371	北方华创	5,630	4,980,072.80	0.06
40	301511	德福科技	33,600	4,833,360.00	0.06
41	000426	兴业银锡	146,000	4,812,160.00	0.06
42	688195	腾景科技	24,952	4,805,256.16	0.06
43	603256	宏和科技	18,100	4,802,473.00	0.06
44	002558	巨人网络	173,900	4,792,684.00	0.06
45	002415	海康威视	136,800	4,678,560.00	0.05
46	603296	华勤技术	62,700	4,656,729.00	0.05
47	600030	中信证券	159,500	4,582,435.00	0.05
48	002329	皇氏集团	1,709,800	4,565,166.00	0.05
49	688677	海泰新光	45,029	4,553,782.77	0.05
50	603920	世运电路	94,600	4,544,584.00	0.05
51	000893	亚钾国际	110,500	4,518,345.00	0.05
52	301041	金百泽	132,400	4,468,500.00	0.05
53	600489	中金黄金	244,300	4,409,615.00	0.05
54	688432	有研硅	108,882	4,352,013.54	0.05
55	600900	长江电力	163,500	4,327,845.00	0.05
56	601208	东材科技	61,100	4,325,269.00	0.05
57	301550	斯菱智驱	46,900	4,288,067.00	0.05
58	601126	四方股份	67,800	4,284,960.00	0.05
59	688183	生益电子	32,080	4,247,392.00	0.05
60	603179	新泉股份	85,108	4,225,612.20	0.05
61	002484	江海股份	40,100	4,210,500.00	0.05
62	002497	雅化集团	206,100	4,198,257.00	0.05
63	000586	汇源通信	317,000	4,187,570.00	0.05
64	600418	江淮汽车	160,700	4,150,881.00	0.05
65	002379	宏桥控股	279,700	4,131,169.00	0.05
66	301057	汇隆新材	179,600	4,130,800.00	0.05
67	002595	豪迈科技	87,200	4,063,520.00	0.05
68	000534	万泽股份	148,300	4,057,488.00	0.05
69	688099	晶晨股份	39,155	4,029,049.50	0.05
70	000977	浪潮信息	57,500	4,025,000.00	0.05
71	600183	生益科技	23,191	4,021,319.40	0.05
72	000408	藏格矿业	57,900	4,013,628.00	0.05
73	300394	天孚通信	13,184	3,990,533.12	0.05
74	605196	华通线缆	152,700	3,985,470.00	0.05
75	688173	希荻微	207,781	3,976,928.34	0.05

76	688469	芯联集成	372,634	3,953,646.74	0.05
77	600809	山西汾酒	36,097	3,947,928.89	0.05
78	300752	隆利科技	292,700	3,942,669.00	0.05
79	688433	华曙高科	45,991	3,936,829.60	0.05
80	605499	东鹏饮料	31,600	3,900,388.00	0.05
81	300128	锦富技术	658,300	3,897,136.00	0.05
82	601088	中国神华	99,768	3,894,942.72	0.05
83	601898	中煤能源	319,700	3,893,946.00	0.05
84	601628	中国人寿	110,000	3,888,500.00	0.05
85	000858	五 粮 液	52,500	3,885,000.00	0.05
86	301479	弘景光电	64,300	3,870,860.00	0.05
87	002027	分众传媒	797,000	3,857,480.00	0.05
88	688593	新相微	98,978	3,852,223.76	0.05
89	688381	帝奥微	71,906	3,846,971.00	0.04
90	688368	晶丰明源	17,752	3,843,663.04	0.04
91	300049	福瑞医科	98,600	3,833,568.00	0.04
92	688625	呈和科技	45,386	3,831,032.26	0.04
93	688733	壹石通	92,371	3,819,540.85	0.04
94	301282	金禄电子	127,680	3,765,283.20	0.04
95	688515	裕太微	15,086	3,752,793.36	0.04
96	002531	天顺风能	444,600	3,747,978.00	0.04
97	002134	天津普林	123,200	3,747,744.00	0.04
98	000039	中集集团	458,500	3,718,435.00	0.04
99	301021	英诺激光	30,500	3,717,950.00	0.04
100	601166	兴业银行	224,300	3,714,408.00	0.04
101	688205	德科立	17,779	3,701,410.01	0.04
102	688775	影石创新	26,570	3,683,930.50	0.04
103	300580	贝斯特	182,900	3,678,119.00	0.04
104	688499	利元亨	69,966	3,676,713.30	0.04
105	600547	山东黄金	159,200	3,675,928.00	0.04
106	002488	金固股份	412,500	3,675,375.00	0.04
107	002241	歌尔股份	163,100	3,674,643.00	0.04
108	605056	咸亨国际	228,600	3,657,600.00	0.04
109	601857	中国石油	421,300	3,656,884.00	0.04
110	603019	中科曙光	33,900	3,635,097.00	0.04
111	688556	高测股份	273,679	3,634,457.12	0.04
112	600683	京投发展	314,300	3,614,450.00	0.04
113	600893	航发动力	94,100	3,607,794.00	0.04
114	002132	恒星科技	662,100	3,581,961.00	0.04
115	603162	海通发展	397,800	3,568,266.00	0.04
116	688166	博瑞医药	101,913	3,567,974.13	0.04
117	601225	陕西煤业	175,100	3,563,285.00	0.04
118	688090	瑞松科技	33,457	3,561,497.65	0.04

119	000678	襄阳轴承	418,700	3,558,950.00	0.04
120	600629	华建集团	293,400	3,553,074.00	0.04
121	688778	厦钨新能	65,275	3,550,960.00	0.04
122	601600	中国铝业	431,900	3,550,218.00	0.04
123	688387	信科移动	178,384	3,539,138.56	0.04
124	000617	中油资本	535,100	3,526,309.00	0.04
125	300227	光韵达	294,200	3,500,980.00	0.04
126	300057	万顺新材	401,700	3,486,756.00	0.04
127	300305	裕兴股份	592,900	3,474,394.00	0.04
128	300584	海辰药业	95,800	3,470,834.00	0.04
129	002460	赣锋锂业	52,700	3,446,580.00	0.04
130	300760	迈瑞医疗	25,300	3,436,499.00	0.04
131	001267	汇绿生态	63,800	3,413,300.00	0.04
132	300953	震裕科技	25,500	3,409,350.00	0.04
133	688400	凌云光	51,479	3,407,909.80	0.04
134	600233	圆通速递	214,800	3,383,100.00	0.04
135	300255	常山药业	143,200	3,353,744.00	0.04
136	600309	万华化学	48,700	3,331,567.00	0.04
137	688668	鼎通科技	8,919	3,329,462.70	0.04
138	002294	信立泰	104,400	3,329,316.00	0.04
139	002077	大港股份	170,800	3,294,732.00	0.04
140	688516	奥特维	57,022	3,272,492.58	0.04
141	002396	星网锐捷	170,390	3,266,376.30	0.04
142	600026	中远海能	181,600	3,257,904.00	0.04
143	300184	力源信息	185,600	3,257,280.00	0.04
144	688693	锆威特	31,226	3,245,942.70	0.04
145	600601	方正科技	233,700	3,234,408.00	0.04
146	300219	鸿利智汇	308,200	3,214,526.00	0.04
147	601728	中国电信	617,900	3,206,901.00	0.04
148	000978	桂林旅游	613,700	3,203,514.00	0.04
149	688568	中科星图	77,111	3,197,793.17	0.04
150	601615	明阳智能	275,900	3,192,163.00	0.04
151	300450	先导智能	78,100	3,180,232.00	0.04
152	600150	中国船舶	94,000	3,176,260.00	0.04
153	300842	帝科股份	35,400	3,156,618.00	0.04
154	688258	卓易信息	26,626	3,156,246.04	0.04
155	600988	赤峰黄金	119,400	3,142,608.00	0.04
156	688031	星环科技	27,234	3,136,812.12	0.04
157	300418	昆仑万维	77,500	3,127,900.00	0.04
158	603501	豪威集团	32,770	3,108,234.50	0.04
159	000034	神州数码	111,900	3,105,225.00	0.04
160	603031	安孚科技	58,300	3,104,475.00	0.04
161	002545	东方铁塔	188,900	3,063,958.00	0.04

162	688523	航天环宇	57,760	3,026,624.00	0.04
163	300281	金明精机	500,600	3,018,618.00	0.04
164	002465	海格通信	235,700	3,009,889.00	0.04
165	600104	上汽集团	305,100	2,977,776.00	0.03
166	002677	浙江美大	537,600	2,972,928.00	0.03
167	601611	中国核建	265,700	2,962,555.00	0.03
168	688223	晶科能源	622,523	2,956,984.25	0.03
169	688536	思瑞浦	8,093	2,946,580.37	0.03
170	600536	中国软件	104,700	2,944,164.00	0.03
171	688658	悦康药业	228,939	2,944,155.54	0.03
172	603936	博敏电子	109,900	2,935,429.00	0.03
173	000062	深圳华强	92,100	2,930,622.00	0.03
174	001203	大中矿业	97,300	2,914,135.00	0.03
175	300145	南方泵业	532,400	2,901,580.00	0.03
176	605598	上海港湾	74,500	2,863,035.00	0.03
177	600408	安泰集团	1,202,500	2,861,950.00	0.03
178	002645	华宏科技	102,200	2,811,522.00	0.03
179	000967	盈峰环境	266,400	2,805,192.00	0.03
180	002180	奔图科技	170,300	2,786,108.00	0.03
181	300679	电连技术	46,400	2,783,536.00	0.03
182	600103	青山纸业	904,900	2,778,043.00	0.03
183	002219	新里程	1,605,500	2,777,515.00	0.03
184	300322	硕贝德	110,200	2,777,040.00	0.03
185	002607	中公教育	1,528,500	2,751,300.00	0.03
186	300703	创源股份	214,400	2,737,888.00	0.03
187	000035	中国天楹	564,500	2,726,535.00	0.03
188	300243	瑞丰高材	125,400	2,726,196.00	0.03
189	002676	顺威股份	544,500	2,711,610.00	0.03
190	002173	创新医疗	165,400	2,709,252.00	0.03
191	600050	中国联通	676,000	2,704,000.00	0.03
192	002079	苏州固锝	179,900	2,703,897.00	0.03
193	300812	易天股份	92,160	2,701,209.60	0.03
194	600592	龙溪股份	190,300	2,694,648.00	0.03
195	300846	首都在线	126,900	2,691,549.00	0.03
196	301076	新瀚新材	102,800	2,691,304.00	0.03
197	001979	招商蛇口	414,800	2,667,164.00	0.03
198	301069	凯盛新材	132,795	2,661,211.80	0.03
199	300410	正业科技	238,900	2,644,623.00	0.03
200	000875	电投绿能	513,200	2,642,980.00	0.03
201	002121	科陆电子	484,200	2,638,890.00	0.03
202	002865	钧达股份	44,200	2,637,856.00	0.03
203	002506	协鑫集成	828,000	2,633,040.00	0.03
204	002829	星网宇达	149,800	2,630,488.00	0.03

205	603612	索通发展	144,200	2,614,346.00	0.03
206	600821	金开新能	415,600	2,597,500.00	0.03
207	603067	振华股份	56,000	2,592,240.00	0.03
208	301293	三博脑科	53,800	2,592,084.00	0.03
209	301377	鼎泰高科	4,700	2,589,230.00	0.03
210	002284	亚太股份	272,300	2,584,127.00	0.03
211	300351	永贵电器	156,400	2,580,600.00	0.03
212	000938	紫光股份	89,100	2,571,426.00	0.03
213	300222	科大智能	185,500	2,569,175.00	0.03
214	002703	浙江世宝	179,400	2,552,862.00	0.03
215	605365	立达信	174,100	2,503,558.00	0.03
216	600452	涪陵电力	267,600	2,496,708.00	0.03
217	300879	大叶股份	159,200	2,496,256.00	0.03
218	603308	应流股份	41,100	2,482,440.00	0.03
219	000425	徐工机械	306,800	2,482,012.00	0.03
220	301071	力量钻石	26,700	2,469,750.00	0.03
221	002125	湘潭电化	180,000	2,458,800.00	0.03
222	002104	恒宝股份	237,100	2,444,501.00	0.03
223	603076	乐惠国际	117,500	2,434,600.00	0.03
224	002045	国光电器	306,600	2,406,810.00	0.03
225	600498	烽火通信	32,700	2,406,720.00	0.03
226	002195	岩山科技	367,200	2,401,488.00	0.03
227	300682	朗新科技	240,900	2,384,910.00	0.03
228	002092	中泰化学	621,300	2,379,579.00	0.03
229	002487	大金重工	41,000	2,376,770.00	0.03
230	000975	山金国际	139,800	2,376,600.00	0.03
231	688127	蓝特光学	24,319	2,373,534.40	0.03
232	000157	中联重科	337,100	2,349,587.00	0.03
233	603083	剑桥科技	9,100	2,319,317.00	0.03
234	600875	东方电气	80,300	2,310,231.00	0.03
235	600725	云维股份	739,500	2,285,055.00	0.03
236	688717	艾罗能源	27,618	2,280,418.26	0.03
237	688111	金山办公	10,495	2,235,959.75	0.03
238	002405	四维图新	345,100	2,232,797.00	0.03
239	000878	云南铜业	139,900	2,221,612.00	0.03
240	301086	鸿富瀚	10,600	2,218,368.00	0.03
241	603790	雅运股份	103,900	2,217,226.00	0.03
242	300274	阳光电源	13,800	2,194,476.00	0.03
243	600036	招商银行	61,800	2,193,900.00	0.03
244	002493	荣盛石化	204,000	2,193,000.00	0.03
245	000949	新乡化纤	344,700	2,185,398.00	0.03
246	300290	ST 荣科	327,600	2,178,540.00	0.03
247	301628	强达电路	20,600	2,172,270.00	0.03

248	601601	中国太保	75,600	2,156,112.00	0.03
249	688072	拓荆科技	2,451	2,155,728.03	0.03
250	000959	首钢股份	609,100	2,137,941.00	0.02
251	002685	华东重机	329,700	2,129,862.00	0.02
252	002798	帝欧水华	424,000	2,115,760.00	0.02
253	301389	隆扬电子	24,300	2,108,997.00	0.02
254	688700	XD 东威科	23,507	2,101,525.80	0.02
255	601127	赛力斯	34,200	2,094,750.00	0.02
256	000887	中鼎股份	117,000	2,093,130.00	0.02
257	601398	工商银行	294,600	2,082,822.00	0.02
258	600458	时代新材	125,500	2,077,025.00	0.02
259	000737	北方铜业	155,300	2,053,066.00	0.02
260	688300	联瑞新材	8,378	2,047,583.20	0.02
261	603259	药明康德	16,400	2,041,964.00	0.02
262	001211	双枪科技	83,500	1,990,640.00	0.02
263	688277	天智航	115,726	1,978,914.60	0.02
264	002539	云图控股	169,500	1,918,740.00	0.02
265	300139	晓程科技	52,400	1,915,220.00	0.02
266	600188	兖矿能源	106,600	1,894,282.00	0.02
267	688008	澜起科技	5,838	1,809,196.20	0.02
268	688107	安路科技	39,462	1,799,467.20	0.02
269	300724	捷佳伟创	24,200	1,708,520.00	0.02
270	000060	中金岭南	225,200	1,704,764.00	0.02
271	688257	新锐股份	16,622	1,693,781.80	0.02
272	301002	崧盛股份	43,400	1,675,240.00	0.02
273	300277	汽轮科技	110,800	1,666,432.00	0.02
274	600585	海螺水泥	97,200	1,647,540.00	0.02
275	300991	创益通	46,600	1,640,786.00	0.02
276	688390	固德威	14,551	1,578,929.01	0.02
277	002947	恒铭达	20,500	1,559,025.00	0.02
278	000807	云铝股份	69,900	1,547,586.00	0.02
279	600299	安迪苏	196,700	1,544,095.00	0.02
280	603619	中曼石油	81,500	1,524,865.00	0.02
281	001337	四川黄金	40,900	1,499,394.00	0.02
282	001316	润贝航科	45,400	1,497,292.00	0.02
283	600721	百花医药	222,000	1,469,640.00	0.02
284	300835	龙磁科技	6,300	1,445,787.00	0.02
285	000753	漳州发展	319,500	1,434,555.00	0.02
286	300905	宝丽迪	27,400	1,386,440.00	0.02
287	002283	天润工业	142,500	1,375,125.00	0.02
288	002922	伊戈尔	41,600	1,364,480.00	0.02
289	688655	迅捷兴	25,469	1,364,119.64	0.02
290	000810	创维数字	101,500	1,344,875.00	0.02

291	002943	宇晶股份	30,100	1,331,323.00	0.02
292	688355	明志科技	68,789	1,324,188.25	0.02
293	603829	洛凯股份	79,700	1,304,689.00	0.02
294	301607	富特科技	24,800	1,295,800.00	0.02
295	301251	威尔高	24,200	1,289,376.00	0.02
296	603626	科森科技	67,000	1,239,500.00	0.01
297	002916	深南电路	2,700	1,236,330.00	0.01
298	688519	南亚新材	3,223	1,224,868.92	0.01
299	300254	仟源医药	152,200	1,219,122.00	0.01
300	002857	三晖电气	67,300	1,182,461.00	0.01
301	688676	金盘科技	13,938	1,179,712.32	0.01
302	300838	浙江力诺	87,700	1,170,795.00	0.01
303	300923	研奥股份	52,100	1,160,788.00	0.01
304	603177	德创环保	139,000	1,149,530.00	0.01
305	688517	金冠电气	65,404	1,143,261.92	0.01
306	301198	喜悦智行	85,300	1,143,020.00	0.01
307	600066	宇通客车	42,600	1,142,106.00	0.01
308	002775	文科股份	333,300	1,136,553.00	0.01
309	001373	翔腾新材	37,600	1,133,640.00	0.01
310	002760	凤形股份	69,000	1,132,980.00	0.01
311	300121	阳谷华泰	89,800	1,131,480.00	0.01
312	300517	海波重科	120,100	1,131,342.00	0.01
313	300806	斯迪克	10,100	1,131,200.00	0.01
314	603331	百达精工	106,100	1,131,026.00	0.01
315	603818	曲美家居	380,500	1,130,085.00	0.01
316	688132	邦彦技术	85,732	1,127,375.80	0.01
317	002652	扬子新材	264,600	1,127,196.00	0.01
318	688659	元琛科技	107,857	1,126,027.08	0.01
319	600807	济高发展	481,100	1,125,774.00	0.01
320	688092	爱科科技	52,818	1,121,854.32	0.01
321	601633	长城汽车	74,300	1,121,187.00	0.01
322	688638	誉辰智能	35,917	1,119,532.89	0.01
323	688681	科汇股份	80,071	1,119,392.58	0.01
324	300417	南华仪器	109,000	1,118,340.00	0.01
325	300605	恒锋信息	121,000	1,118,040.00	0.01
326	603356	华菱精工	67,600	1,116,752.00	0.01
327	300778	新城市	116,900	1,116,395.00	0.01
328	002858	力盛体育	102,300	1,116,093.00	0.01
329	301098	金埔园林	136,100	1,116,020.00	0.01
330	300635	中达安	91,700	1,115,989.00	0.01
331	688597	煜邦电力	171,598	1,115,387.00	0.01
332	301601	惠通科技	71,200	1,112,144.00	0.01
333	688038	中科通达	66,070	1,111,297.40	0.01

334	600778	友好集团	227,100	1,110,519.00	0.01
335	603860	中公高科	45,900	1,110,321.00	0.01
336	300556	丝路视觉	63,900	1,109,943.00	0.01
337	600992	贵绳股份	128,700	1,109,394.00	0.01
338	300615	欣天科技	110,600	1,109,318.00	0.01
339	003042	中农联合	91,300	1,109,295.00	0.01
340	688021	奥福科技	57,288	1,109,095.68	0.01
341	300614	百川畅银	114,500	1,108,360.00	0.01
342	301231	荣信文化	43,700	1,108,232.00	0.01
343	603810	丰山集团	99,500	1,107,435.00	0.01
344	001278	一彬科技	72,000	1,107,360.00	0.01
345	688288	鸿泉技术	62,267	1,106,484.59	0.01
346	300886	华业香料	55,600	1,106,440.00	0.01
347	300176	鸿特科技	228,000	1,105,800.00	0.01
348	600802	福建水泥	268,200	1,104,984.00	0.01
349	300876	蒙泰高新	77,100	1,104,843.00	0.01
350	688004	博汇科技	60,692	1,104,594.40	0.01
351	600257	大湖股份	255,100	1,104,583.00	0.01
352	300844	山水比德	49,700	1,103,837.00	0.01
353	001366	播恩集团	101,800	1,103,512.00	0.01
354	000633	合金投资	231,800	1,103,368.00	0.01
355	300535	达威股份	80,900	1,102,667.00	0.01
356	300106	西部牧业	112,000	1,102,080.00	0.01
357	688058	宝兰德	52,667	1,101,793.64	0.01
358	600706	曲江文旅	163,700	1,101,701.00	0.01
359	300549	优德精密	84,600	1,101,492.00	0.01
360	688203	海正生材	110,337	1,101,163.26	0.01
361	688528	秦川物联	120,456	1,100,967.84	0.01
362	002513	蓝丰生化	230,300	1,100,834.00	0.01
363	003001	中岩大地	85,000	1,100,750.00	0.01
364	603151	邦基科技	100,100	1,100,099.00	0.01
365	301131	聚赛龙	34,200	1,098,846.00	0.01
366	688565	力源科技	116,267	1,098,723.15	0.01
367	002809	红墙股份	147,600	1,098,144.00	0.01
368	001231	农心科技	60,200	1,098,048.00	0.01
369	600455	博通股份	50,000	1,098,000.00	0.01
370	301298	东利机械	94,900	1,097,993.00	0.01
371	605177	东亚药业	64,100	1,096,751.00	0.01
372	301519	舜禹股份	101,000	1,095,850.00	0.01
373	301515	港通医疗	62,500	1,095,625.00	0.01
374	300405	科隆股份	211,400	1,095,052.00	0.01
375	002909	集泰股份	221,600	1,094,704.00	0.01
376	002696	百洋股份	220,200	1,094,394.00	0.01

376	301113	雅艺科技	73,400	1,094,394.00	0.01
377	000856	冀东装备	153,000	1,093,950.00	0.01
378	688393	安必平	61,447	1,092,527.66	0.01
379	603968	醋化股份	117,900	1,091,754.00	0.01
380	002205	国统股份	108,200	1,091,738.00	0.01
381	603073	彩蝶实业	73,200	1,091,412.00	0.01
382	301167	建研设计	88,000	1,090,320.00	0.01
383	002778	中晟高科	71,700	1,089,840.00	0.01
384	002144	宏达高科	110,601	1,089,419.85	0.01
385	002629	仁智股份	253,300	1,089,190.00	0.01
386	600159	大龙地产	492,600	1,088,646.00	0.01
387	000619	海螺新材	247,400	1,088,560.00	0.01
388	003023	彩虹集团	55,900	1,086,696.00	0.01
389	002679	福建金森	137,900	1,086,652.00	0.01
390	003011	海象新材	59,800	1,086,566.00	0.01
391	603768	常青股份	119,000	1,086,470.00	0.01
392	600448	华纺股份	431,000	1,086,120.00	0.01
393	603022	新通联	135,900	1,085,841.00	0.01
394	688067	爱威科技	53,876	1,085,601.40	0.01
395	000995	皇台酒业	114,100	1,083,950.00	0.01
396	600697	欧亚集团	111,500	1,083,780.00	0.01
397	600561	江西长运	218,900	1,083,555.00	0.01
398	600099	林海股份	135,700	1,082,886.00	0.01
399	300571	平治信息	23,700	1,082,142.00	0.01
400	688613	奥精医疗	76,623	1,081,150.53	0.01
401	600493	凤竹纺织	205,900	1,078,916.00	0.01
402	603908	牧高笛	63,800	1,076,944.00	0.01
403	603182	嘉华股份	94,400	1,076,160.00	0.01
404	600689	上海三毛	110,900	1,075,730.00	0.01
405	605180	华生科技	90,600	1,073,610.00	0.01
406	688013	天臣医疗	43,440	1,071,664.80	0.01
407	688329	艾隆科技	52,467	1,060,358.07	0.01
408	603950	长源东谷	12,500	1,055,375.00	0.01
409	600276	恒瑞医药	19,640	1,022,065.60	0.01
410	603738	泰晶科技	16,900	1,014,845.00	0.01
411	002927	泰永长征	51,600	1,003,620.00	0.01
412	688800	瑞可达	10,318	990,218.46	0.01
413	002053	云南能投	96,600	949,578.00	0.01
414	003003	天元股份	95,000	945,250.00	0.01
415	301336	趣睡科技	23,560	941,222.00	0.01
416	600149	廊坊发展	199,900	897,551.00	0.01
417	300409	道氏技术	44,900	894,857.00	0.01
418	688078	龙软科技	42,487	894,351.35	0.01

419	000702	正虹科技	179,800	891,808.00	0.01
420	002913	奥士康	13,800	882,372.00	0.01
421	300246	宝莱特	62,700	882,189.00	0.01
422	600137	浪莎股份	54,200	879,666.00	0.01
423	603183	建研院	247,000	876,850.00	0.01
424	301486	致尚科技	4,200	874,944.00	0.01
425	688466	金科环境	68,035	872,889.05	0.01
426	603208	江山欧派	81,400	870,980.00	0.01
427	002820	桂发祥	103,200	866,880.00	0.01
428	603168	莎普爱思	183,500	866,120.00	0.01
429	000953	中哲精化	167,400	863,784.00	0.01
430	688426	康为世纪	46,767	857,706.78	0.01
431	002133	广宇集团	358,600	857,054.00	0.01
432	000663	永安林业	167,900	856,290.00	0.01
433	002873	新天药业	116,900	855,708.00	0.01
434	300126	锐奇股份	147,900	854,862.00	0.01
435	003008	开普检测	50,000	853,500.00	0.01
436	300851	交大思诺	38,300	852,175.00	0.01
437	600202	哈空调	189,900	850,752.00	0.01
438	002817	黄山胶囊	145,100	850,286.00	0.01
439	600051	宁波联合	150,900	849,567.00	0.01
440	600235	民丰特纸	170,400	846,888.00	0.01
441	603214	爱婴室	69,900	846,489.00	0.01
442	600883	博闻科技	120,700	844,900.00	0.01
443	605567	春雪食品	105,100	839,749.00	0.01
444	301037	保立佳	69,900	838,800.00	0.01
445	301529	福赛科技	8,700	838,332.00	0.01
446	300892	品渥食品	44,600	837,588.00	0.01
447	300335	迪森股份	170,700	831,309.00	0.01
448	000548	湖南投资	202,600	828,634.00	0.01
449	002732	燕塘乳业	66,800	828,320.00	0.01
450	301505	苏州规划	49,800	801,780.00	0.01
451	600577	精达股份	80,800	790,224.00	0.01
452	002343	慈文传媒	178,900	780,004.00	0.01
453	301010	晶雪节能	47,800	778,662.00	0.01
454	603079	圣达生物	68,000	769,760.00	0.01
455	301163	宏德股份	34,700	769,646.00	0.01
456	688089	嘉必优	72,326	767,378.86	0.01
457	688051	佳华科技	33,148	761,741.04	0.01
458	002836	新宏泽	81,800	755,832.00	0.01
459	600097	开创国际	96,800	753,104.00	0.01
460	300707	威唐工业	67,200	751,296.00	0.01
461	603385	惠达卫浴	153,300	748,104.00	0.01

462	300645	正元智慧	63,200	743,864.00	0.01
463	000705	浙江震元	126,700	741,195.00	0.01
464	301006	迈拓股份	59,000	740,450.00	0.01
465	000712	锦龙股份	83,300	738,038.00	0.01
466	002999	天禾股份	138,600	737,352.00	0.01
467	605222	起帆电缆	31,400	732,248.00	0.01
468	001260	坤泰股份	46,600	729,290.00	0.01
469	300675	建科院	61,000	722,850.00	0.01
470	600331	宏达股份	65,700	722,043.00	0.01
471	000985	大庆华科	50,500	718,615.00	0.01
472	600444	国机通用	55,200	716,496.00	0.01
473	300514	友讯达	76,600	716,210.00	0.01
474	601869	长飞光纤	1,300	709,670.00	0.01
475	301065	本立科技	40,100	707,765.00	0.01
476	002591	恒大高新	113,800	696,456.00	0.01
477	600661	昂立教育	100,100	691,691.00	0.01
478	603052	可川科技	8,500	688,415.00	0.01
479	002188	中天服务	140,100	686,490.00	0.01
480	002813	路畅科技	36,100	682,290.00	0.01
481	300030	阳普医疗	116,900	679,189.00	0.01
482	603185	弘元绿能	40,600	677,614.00	0.01
483	688352	顾中科技	27,867	673,824.06	0.01
484	301285	鸿日达	6,100	673,013.00	0.01
485	001219	青岛食品	58,600	671,556.00	0.01
486	300958	建工修复	62,900	669,256.00	0.01
487	301126	达嘉维康	77,800	665,190.00	0.01
488	688606	奥泰生物	16,192	665,167.36	0.01
489	001389	广合科技	2,800	664,300.00	0.01
490	600128	苏豪弘业	86,600	657,294.00	0.01
491	603787	新日股份	72,300	657,207.00	0.01
492	002968	新大正	77,300	653,958.00	0.01
493	600362	江西铜业	15,100	653,830.00	0.01
494	300387	富邦科技	95,900	651,161.00	0.01
495	688316	青云科技	11,817	638,118.00	0.01
496	301005	超捷股份	5,700	635,892.00	0.01
497	600774	汉商集团	101,400	634,764.00	0.01
498	000933	神火股份	29,900	633,880.00	0.01
499	300279	和晶科技	104,300	631,015.00	0.01
500	688435	英方软件	19,616	627,712.00	0.01
501	603159	上海亚虹	36,300	626,901.00	0.01
502	301270	汉仪股份	24,300	624,024.00	0.01
503	300956	英力股份	54,900	617,076.00	0.01
504	301606	绿联科技	10,100	616,302.00	0.01

505	301359	东南电子	38,800	616,144.00	0.01
506	301040	中环海陆	25,200	614,124.00	0.01
507	688110	东芯股份	3,006	612,322.20	0.01
508	300275	梅安森	76,200	611,886.00	0.01
509	300565	科信技术	60,000	610,800.00	0.01
510	300651	金陵体育	34,200	610,470.00	0.01
511	603629	利通电子	3,400	607,954.00	0.01
512	300930	屹通新材	21,300	607,050.00	0.01
513	300637	扬帆新材	58,400	606,192.00	0.01
514	600969	郴电国际	79,300	605,059.00	0.01
515	300157	新锦动力	163,500	603,315.00	0.01
516	601798	蓝科高新	83,300	603,092.00	0.01
517	002769	普路通	92,200	602,066.00	0.01
518	002377	国创高新	238,800	601,776.00	0.01
519	000802	北京文化	172,900	601,692.00	0.01
520	300977	深圳瑞捷	39,000	601,380.00	0.01
521	002725	跃岭股份	48,800	601,216.00	0.01
522	002636	金安国纪	5,000	599,850.00	0.01
523	600844	金煤科技	247,700	599,434.00	0.01
524	603709	中源家居	44,100	597,114.00	0.01
525	300804	广康生化	19,100	597,066.00	0.01
526	601996	丰林集团	286,600	593,262.00	0.01
527	002387	维信诺	64,900	584,100.00	0.01
528	301188	力诺药包	8,700	582,030.00	0.01
529	300753	爱朋医疗	30,700	581,151.00	0.01
530	301063	海锅股份	34,500	578,220.00	0.01
531	002897	意华股份	6,500	571,870.00	0.01
532	601698	中国卫通	18,900	571,725.00	0.01
533	300408	三环集团	3,304	551,437.60	0.01
534	605068	明新旭腾	32,400	543,672.00	0.01
535	605116	奥锐特	28,300	535,436.00	0.01
536	603778	国晟科技	42,500	522,750.00	0.01
537	688521	芯原股份	1,395	517,740.30	0.01
538	300302	同有科技	10,000	511,700.00	0.01
539	600775	南京熊猫	52,900	505,724.00	0.01
540	688030	山石网科	30,980	489,174.20	0.01
541	300077	国民技术	15,300	479,655.00	0.01
542	002278	神开股份	63,500	478,790.00	0.01
543	300982	苏文电能	31,100	469,921.00	0.01
544	002623	亚玛顿	29,600	462,352.00	0.01
545	001300	三柏硕	40,600	458,780.00	0.01
546	603045	福达合金	6,400	456,896.00	0.01
547	300875	捷强装备	15,800	451,406.00	0.01

548	688317	之江生物	29,622	450,254.40	0.01
549	300132	青松股份	78,800	447,584.00	0.01
550	605500	森林包装	72,200	446,196.00	0.01
551	002576	通达动力	30,900	437,235.00	0.01
552	688310	迈得医疗	26,596	408,780.52	0.00
553	002105	信隆健康	82,300	406,562.00	0.00
554	002771	真视通	33,100	406,468.00	0.00
555	688308	欧科亿	2,225	404,527.25	0.00
556	002246	北化股份	20,500	385,400.00	0.00
557	688130	晶华微	13,698	385,187.76	0.00
558	301387	光大同创	4,100	378,922.00	0.00
559	600227	赤天化	149,100	363,804.00	0.00
560	600151	航天机电	30,400	341,088.00	0.00
561	300735	光弘科技	13,300	302,442.00	0.00
562	600833	第一医药	33,100	298,562.00	0.00
563	300332	天壕能源	68,000	292,400.00	0.00
564	001368	通达创智	14,200	292,094.00	0.00
565	002381	双箭股份	55,500	287,490.00	0.00
566	300393	中来股份	39,000	284,310.00	0.00
567	688244	永信至诚	18,014	256,879.64	0.00
568	300677	英科医疗	6,500	254,605.00	0.00
569	688035	德邦科技	2,582	237,027.60	0.00
570	600615	鑫源智造	24,500	226,380.00	0.00
571	605162	新中港	28,300	218,193.00	0.00
572	300461	田中精机	5,800	214,832.00	0.00
573	002995	天地在线	11,800	208,624.00	0.00
574	002566	益盛药业	33,000	199,320.00	0.00
575	603180	金牌家居	13,900	190,708.00	0.00
576	300214	日科化学	17,200	176,300.00	0.00
577	002756	永兴材料	3,100	175,584.00	0.00
578	002012	凯恩股份	27,100	173,711.00	0.00
579	300519	新光药业	14,000	165,900.00	0.00
580	600219	南山铝业	39,900	159,201.00	0.00
581	002142	宁波银行	5,300	157,357.00	0.00
582	601766	中国中车	27,300	141,960.00	0.00
583	300604	长川科技	400	136,568.00	0.00
584	002066	瑞泰科技	6,200	129,146.00	0.00
585	600793	宜宾纸业	8,700	104,661.00	0.00
586	300790	宇瞳光学	4,000	104,440.00	0.00
587	688313	仕佳光子	552	101,926.80	0.00
588	002240	盛新锂能	2,200	98,626.00	0.00
589	603596	伯特利	3,200	79,488.00	0.00
590	002838	道恩股份	2,500	76,550.00	0.00

591	300256	星星科技	27,100	70,731.00	0.00
592	002796	世嘉科技	1,500	61,170.00	0.00
593	600513	联环药业	3,500	50,890.00	0.00
594	000625	长安汽车	6,900	49,473.00	0.00
595	002910	庄园牧场	4,200	46,536.00	0.00
596	688192	迪哲医药	579	23,119.47	0.00
597	603982	泉峰汽车	3,300	18,447.00	0.00
598	300033	同花顺	20	4,820.00	0.00
599	001378	德冠新材	80	1,432.80	0.00
600	600075	新疆天业	60	242.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	29,909,827.00	0.47
2	603256	宏和科技	20,232,136.39	0.32
3	688498	源杰科技	19,643,424.18	0.31
4	688025	杰普特	19,284,342.69	0.30
5	001309	德明利	18,636,953.00	0.29
6	300548	长芯博创	18,499,571.00	0.29
7	600487	亨通光电	18,468,063.00	0.29
8	000338	潍柴动力	17,655,411.00	0.28
9	688257	新锐股份	17,251,820.53	0.27
10	000426	兴业银锡	16,873,736.00	0.26
11	002080	中材科技	16,856,097.00	0.26
12	002463	沪电股份	15,934,426.35	0.25
13	600549	厦门钨业	15,884,720.00	0.25
14	300502	新易盛	15,314,754.00	0.24
15	002353	杰瑞股份	15,227,692.00	0.24
16	688256	寒武纪	15,068,527.07	0.24
17	688048	长光华芯	14,806,380.64	0.23
18	002475	立讯精密	14,576,328.00	0.23
19	002028	思源电气	14,513,127.59	0.23
20	002938	鹏鼎控股	14,058,074.00	0.22

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	001309	德明利	22,417,544.94	0.35
2	300308	中际旭创	21,609,942.88	0.34

3	002463	沪电股份	19,827,027.00	0.31
4	600487	亨通光电	19,523,411.65	0.31
5	688257	新锐股份	18,878,639.00	0.30
6	300548	长芯博创	18,762,166.00	0.29
7	603256	宏和科技	18,398,916.00	0.29
8	300857	协创数据	18,348,892.30	0.29
9	688008	澜起科技	17,893,770.63	0.28
10	688048	长光华芯	16,347,351.02	0.26
11	688498	源杰科技	16,313,727.40	0.25
12	688347	华虹宏力	15,542,140.73	0.24
13	688158	优刻得	15,475,376.47	0.24
14	300394	天孚通信	15,466,021.87	0.24
15	300502	新易盛	15,034,473.00	0.23
16	600549	厦门钨业	15,013,433.00	0.23
17	688025	杰普特	14,954,739.75	0.23
18	688183	生益电子	14,567,498.81	0.23
19	000657	中钨高新	14,458,767.23	0.23
20	300054	鼎龙股份	14,306,034.00	0.22

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	6,160,991,374.59
卖出股票收入（成交）总额	6,021,148,133.54

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	599,750,780.98	7.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,922,747,362.19	57.52
	其中：政策性金融债	702,276,358.90	8.21
4	企业债券	36,365,341.92	0.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,723,550,705.74	20.14
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,282,414,190.83	85.09

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	230023	23 附息国债 23	2,500,000	291,052,868.85	3.40
2	092280080	22 光大银行二级资本债 01A	2,500,000	261,022,808.22	3.05
3	2228003	22 兴业银行二级 01	1,900,000	194,978,676.71	2.28
4	2228041	22 农业银行二级 01	1,900,000	193,734,671.23	2.26
5	232480039	24 广发银行二级资本债 01A	1,700,000	175,745,208.22	2.05

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，中国光大银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中国农业发展银行、国家开发银行、华夏银行股份有限公司、中国工商银行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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,074,034.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,074,034.48

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
430	17,002,874.86	7,306,463,250.59	99.9347	4,772,938.88	0.0653

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	162,136.13	0.0022

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	-	-	-	-	-
基金经理等人员	1,003.58	0.0000	-	-	-
基金管理人股东	6,603,316,762.82	90.3174	2,899,998,000.00	39.6649	3 年
其他	161,132.55	0.0022	-	-	-
合计	6,603,478,898.95	90.3196	2,899,998,000.00	39.6649	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	5,726,474,245.60
本报告期基金总申购份额	1,844,788,945.09
减：本报告期基金总赎回份额	260,027,001.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,311,236,189.47

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况
本基金管理人于 2026 年 4 月 14 日发布公告，自 2026 年 4 月 13 日起熊莹女士担任公司副

总经理（主持工作）职务。

本基金管理人于 2026 年 5 月 23 日发布公告，自 2026 年 5 月 21 日起熊莹女士担任公司总经理职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2026 年 6 月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动已进行备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚等。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚等。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
银河证券	2	12,182,139,508.13	100.00	5,432,331.58	100.00	-

注：1. 拟被基金管理人租用交易单元的证券公司应符合以下标准：

（1）公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定。最近两年未出现连续亏损，或最近一年未出现重大亏损（绝对金额超当期净资产的 10%），或最近一年未出现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。

（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。

2. 交易单元的选择程序：

（1）交易部门根据上述标准，综合考虑公司研究服务需要和交易需求，拟定合作证券公司白名单（以下简称“白名单”），提交至公司总经理办公会审议。

（2）在白名单范围内，由公司投资决策委员会确定租用证券公司的交易单元。

（3）公司与被选择的证券公司签订协议，租用交易单元开展证券交易。

3. 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 基金租用或者通过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 (%)
银河证券	90,576,639.85	100.00	3,402,000,000.00	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	太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 22 日
2	关于太平嘉和三个月定期开放债券型	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 5 日

	发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换等业务公告		
3	太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 31 日
4	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	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 20 日
5	太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 20 日
6	太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 22 日
7	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	2026 年 6 月 12 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	20260101 – 20260630	5,318,631,939.26	1,284,684,823.56	–	6,603,316,762.82	90.3174
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平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 5 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

2026 年 8 月 31 日