

太平智远三个月定期开放股票型发起式证 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55
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	55
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	55

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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 盈利投资者数量占比	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.4 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	56
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
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	58
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金
基金简称	太平智远三个月定期开放股票发起式
基金主代码	013414
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2021 年 8 月 25 日
基金管理人	太平基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	644,459,651.31 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

	(3) 港股通标的股票的投资策略 本基金将采用与 A 股市场相同的个股精选策略，从企业盈利能力，盈利的确定性、成长性、持续性等角度入手，精选未来 3-5 年存在良好的增值可能的投资标的。 3、债券投资策略 本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作，以提高基金收益。本基金将主要采取以下积极管理策略： (1) 久期调整策略 根据对市场利率水平的预期，在预期利率下降时，提高组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益；在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下跌的风险。 (2) 收益率曲线配置策略 在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。 (3) 债券类属配置策略 根据国债、金融债、公司债、可转债、可交换债、资产支持证券等不同类属债券之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的类属债券，减持价值被相对高估的类属债券，借以取得较高收益。 4、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 5、股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。 6、国债期货投资策略 国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。本基金将构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。 (二) 开放期投资策略 在开放期，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化，基金管理人将采取各种有效管理措施，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
--	---

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+中债综合指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金可能投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	太平基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵霖
	联系电话	021-38556613
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn
客户服务电话	021-61560999/400-028-8699	95561
传真	021-38556677	021-62159217
注册地址	上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	刘冬	吕家进

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	118,016,989.55
本期利润	269,151,337.74
加权平均基金份额本期利润	0.4189
本期加权平均净值利润率	32.62%
本期基金份额净值增长率	35.05%
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	74,788,795.21
期末可供分配基金份额利润	0.1160

期末基金资产净值	1,043,612,884.57
期末基金份额净值	1.6194
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	61.94%

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。

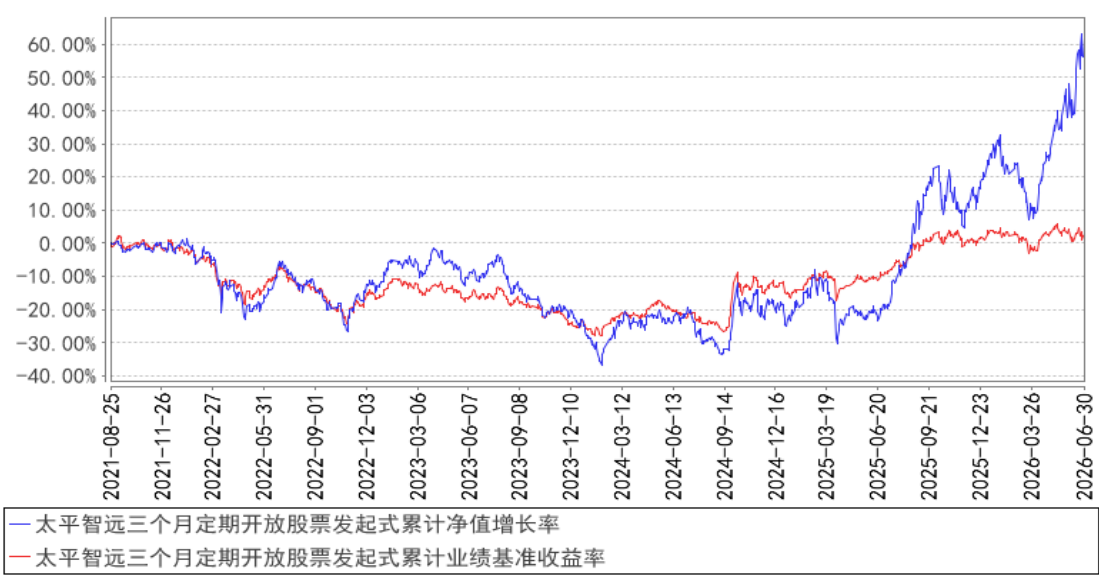
3.2 基金净值表现

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	50.67%	2.32%	5.25%	0.91%	45.42%	1.41%
过去六个月	35.05%	2.10%	1.59%	0.86%	33.46%	1.24%
过去一年	98.29%	2.05%	13.52%	0.77%	84.77%	1.28%
过去三年	80.29%	1.81%	22.57%	0.86%	57.72%	0.95%
自基金合同生效起至今	61.94%	1.62%	2.73%	0.88%	59.21%	0.74%

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

太平智远三个月定期开放股票发起式累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 08 月 25 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		
徐闯	本基金的基金经理	2023 年 7 月 5 日	-	13 年	中南财经政法大学经济学硕士，具有证券投资基金从业资格。徐闯先生自 2013 年 6 月起历任广州广证恒生证券研究所有限公司、方正证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司，从事行业研究工作。2017 年 4 月加入太平基金管理有限公司，曾担任投资经理负责公司专户产品的投资管理工作。2023 年 7 月 5 日起担任太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2023 年 7 月 5 日起担任太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 26 日起担任太平先进制造混合型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 11 月 13 日起担任太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金基金经理。2026 年 1 月 21 日起担任太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。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。2026 年 4 月 29 日起担任太平智选一年定期开放股票型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 4 月 29 日起担任太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 4 月 29 日起担任太平消费升级一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
刘金	权益投资部总监、本基金的基金经理	2024 年 4 月 17 日	-	25 年	上海社会科学院经济学博士，浙江大学理论经济学博士后，具有证券投资基金从业资格。1996 年 7 月于郑州市包装进出口公司参加工作，2001 年 5 月起先后任职于上海证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、太平资产管理有限公司、格林基金管理有限公司、百年保险资产管理有限责任公司、国金证券资产管理有限公司。2023 年 6 月加入太平基金管理有限公司，现任权益投资部总监。2024 年 4 月 17 日起担任太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金基金经理。

- 注：1、基金经理的任职日期、离任日期一般情况下根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；
- 2、证券基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定；
- 3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，未发生违法违规或未履行基金合同的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

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

2026 年上半年，A 股市场整体呈现先扬后抑再修复的宽幅震荡走势，结构性分化行情达到极致。第二季度这一情况演化更加明显，直至二季度末三季度初，市场风格稍有再平衡之势。上半年上证指数累计上涨 3.16%，深证成指上涨 19.82%，创业板指上涨 35.58%，科创 50 指数更是上涨 64.25%；而同期，传统蓝筹指数表现平淡，上证 50 指数甚至出现下跌。

上半年市场行情大致可分为三个阶段。第一阶段为 1 月初至春节前的春季躁动。第二阶段为春节后至 3 月中旬，受中东地缘冲突升温、国内政策落地节奏扰动、海外流动性预期反复等多重变量冲击，市场进入震荡调整期。第三阶段为 3 月下旬至 6 月底，随着地缘局势逐步缓和、国内经济数据持续验证，市场在震荡中重新凝聚共识，科技成长主线进一步强化，推动指数修复上行。

行业层面的分化尤为剧烈。申万 31 个一级行业中仅 10 个录得上涨，电子、通信、建筑材料和机械设备领涨，超六成行业上半年收跌。港股市场上半年则明显承压。港股权重端偏金融、能源等旧经济板块，与全球资金追逐科技成长的结构性偏好形成错配，成为港股跑输的核心症结。港股内部同样呈现 K 型分化，AI 产业链驱动的电子板块逆势上涨。

本基金延续了一直以来的哑铃型策略，动态调整“科技成长+其他资产”的配置比例。2026 年上半年，本基金主要在科技成长板块内部积极进行行业轮动，重点布局了 AI 算力基础设施（光模块、存储、PCB 等）、半导体设备与材料等景气度持续向上的子方向，同时，适度配置了能源设备、机器人和新能源等景气度持续高位的相关个股。另外，本基金也适度参与了有色、化工等顺周期的资产。

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 35.05%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%。

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 2026 年下半年，我们认为 A 股市场有望在震荡中延续结构性行情。尽管 7 月初以来的一段时间，科技股的表现不尽如人意，但我们判断，未来市场的核心驱动力仍将来自科技产业趋势

的持续深化与盈利改善的逐步兑现。

2026 年一季报数据显示科创 50 盈利增速出现爆发性增长，远超上证 50 净利润的增速，持续走阔的盈利剪刀差，为结构性行情提供了底层基本面支撑。随着供给侧出清持续推进、需求端逐步复苏，全部 A 股非金融企业盈利增速有望迎来过去五年来的首次有效反弹。2026 年是十五五规划的开局之年，科技创新、产业链自主可控、能源转型与内需扩大预计将成为政策重点，为市场提供持续的主题支撑。今年下半年，特斯拉机器人量产的迫近，引发了国内 T 链公司盈利上修的预期，宇树的上市或成为国内机器人产业链回暖的起点。我们注意到，商业航天等板块尽管上半年表现不佳，但下半年子行业的基本面在改善，海外 SPACEX 上市后也会带动国内相关公司盈利的变化。

风格方面，我们判断下半年市场或将呈现再平衡特征。当前科技成长板块估值已处于较高水平，部分子行业存在阶段性回调压力，但 AI 产业链的产业趋势远未结束。从全球视角看，美国 AI 需求仍在向纵深演绎，从未来 2 年维度看，硬件方面的不断深化带来存储、PCB、光模块等相关需求的持续增长，海外算力仍处于加速投入的阶段，但中间技术的迭代和子行业投资的边际变化随时会影响美股的估值变化，进而映射到 A 股的相应波动。国内科技主线则聚焦于自主可控的光刻机产业链等方向。国内长鑫长存的上市，或为国产算力估值提升提供一定的情绪动力。与此同时，随着中东局势逐步明朗以及海外加息靴子的落地，资源周期板块的配置价值仍将阶段性凸显。

港股方面，当前恒生指数估值处于历史低位，随着 AI 产业链的结构性修复和部分消费板块的边际改善，同时，随着越来越多 A 股优秀公司南下港股上市带来新鲜标的，下半年或将迎来一定的修复机会。但可以预计，分化格局仍将是主旋律，盈利增长将主要靠景气赛道驱动。

本基金主要基于中长期视角，在资产配置策略和行业优选策略的大框架下，通过定性和定量相结合的个股选择策略，精选具备长期增长潜力的上市公司，以期获得正向的收益。目前看，我们仍将继续坚持哑铃型策略，在“科技成长+其他资产”的框架下动态调整配置比例，密切关注科技板块内部子行业轮动带来的风险与机会，同时保持对周期资产和港股优质标的的关注，力争为持有人创造长期稳健回报。

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

报告期内，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、基金合同和托管协议的规定，诚信、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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：太平智远三个月定期开放股票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	20,692,650.79	14,691,338.71
结算备付金		4,462,755.87	1,585,911.25
存出保证金		386,069.90	553,005.68
交易性金融资产	6.4.7.2	1,011,475,781.21	731,107,194.22
其中：股票投资		970,408,305.32	694,176,928.06
基金投资		-	-
债券投资		41,067,475.89	36,930,266.16
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		8,706,448.20	4,475,761.51
应收股利		183,257.58	19,133.02
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,045,906,963.55	752,432,344.39
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		-	-
应付清算款		-	1,204,933.99
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		865,180.81	670,896.21
应付托管费		157,305.60	121,981.16
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		815.68	7.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,270,776.89	971,978.58
负债合计		2,294,078.98	2,969,797.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	644,459,651.31	625,002,148.20
未分配利润	6.4.7.11	399,153,233.26	124,460,398.63
净资产合计		1,043,612,884.57	749,462,546.83
负债和净资产总计		1,045,906,963.55	752,432,344.39

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6194 元，基金份额总额 644,459,651.31 份。

6.2 利润表

会计主体：太平智远三个月定期开放股票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		274,537,335.57	12,431,449.30
1. 利息收入		38,457.70	106,565.82
其中：存款利息收入	6.4.7.12	38,457.70	85,811.49
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		-	20,754.33
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		123,364,529.68	-1,155,283.84
其中：股票投资收益	6.4.7.13	120,816,812.52	-5,849,078.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	319,884.48	164,452.36
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	2,227,832.68	4,529,341.96
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	151,134,348.19	13,480,167.32
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		5,385,997.83	5,207,518.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,486,115.37	4,339,510.23
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	815,657.35	789,001.92
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		88.00	74.80
8. 其他费用	6.4.7.22	84,137.11	78,931.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		269,151,337.74	7,223,931.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		269,151,337.74	7,223,931.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		269,151,337.74	7,223,931.07

6.3 净资产变动表

会计主体：太平智远三个月定期开放股票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	625,002,148.20	124,460,398.63	749,462,546.83
二、本期期初净资产	625,002,148.20	124,460,398.63	749,462,546.83
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	19,457,503.11	274,692,834.63	294,150,337.74
（一）、综合收益总	-	269,151,337.74	269,151,337.74

额			
（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）	19,457,503.11	5,541,496.89	24,999,000.00
其中：1. 基金申购款	19,457,503.11	5,541,496.89	24,999,000.00
2. 基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	644,459,651.31	399,153,233.26	1,043,612,884.57
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	1,000,000,267.29	-202,208,325.82	797,791,941.47
二、本期期初净资产	1,000,000,267.29	-202,208,325.82	797,791,941.47
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-374,998,119.09	87,636,051.63	-287,362,067.46
（一）、综合收益总额	-	7,223,931.07	7,223,931.07
（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）	-374,998,119.09	80,412,120.56	-294,585,998.53
其中：1. 基金申购款	1,880.91	-379.44	1,501.47
2. 基金赎回款	-375,000,000.00	80,412,500.00	-294,587,500.00
（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	625,002,148.20	-114,572,274.19	510,429,874.01

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

基金管理人负责人

史彦刚

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

太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]2633号《关于准予太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由太平基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平智远三个月定期开放股票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1,000,000,000.00元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。经向中国证监会备案,《太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金基金合同》于2021年8月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,000,000,000.00份,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为1,000,000,000.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

本基金的投资范围主要为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、政府机构债券、地方政府债券、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券)、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场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的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:股票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15个工作日、开放期及开放期结束后15个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制;港股通标的股票的投资比例不超过基金股票资产的50%;开放期内,本基金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,现金或到期日在一年以内的政府债券的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和股指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：沪深 300 指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+中债综合指数收益率×20%。

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	20,692,650.79
等于：本金	20,690,982.65
加：应计利息	1,668.14
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	20,692,650.79

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		639, 241, 627. 59	-	970, 408, 305. 32	331, 166, 677. 73
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	40, 977, 330. 00	79, 775. 89	41, 067, 475. 89	10, 370. 00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	40, 977, 330. 00	79, 775. 89	41, 067, 475. 89	10, 370. 00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		680, 218, 957. 59	79, 775. 89	1, 011, 475, 781. 21	331, 177, 047. 73

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

本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金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	1,192,425.61
其中：交易所市场	1,192,425.61
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	18,843.91
合计	1,270,776.89

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	625,002,148.20	625,002,148.20
本期申购	19,457,503.11	19,457,503.11
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	644,459,651.31	644,459,651.31

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-42,329,695.07	166,790,093.70	124,460,398.63
本期期初	-42,329,695.07	166,790,093.70	124,460,398.63
本期利润	118,016,989.55	151,134,348.19	269,151,337.74
本期基金份额交易产生的变动数	-898,499.27	6,439,996.16	5,541,496.89
其中：基金申购款	-898,499.27	6,439,996.16	5,541,496.89
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,788,795.21	324,364,438.05	399,153,233.26

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	29,935.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,821.43
其他	700.83
合计	38,457.70

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	120,816,812.52
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	120,816,812.52

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	2,283,602,388.24
减：卖出股票成本总额	2,158,912,067.79
减：交易费用	3,873,507.93
买卖股票差价收入	120,816,812.52

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	232,585.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	87,298.58

券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	319,884.48

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	38,473,657.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	37,960,215.48
减：应计利息总额	426,000.56
减：交易费用	142.84
买卖债券差价收入	87,298.58

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	2,227,832.68
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	2,227,832.68

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	151,134,348.19
股票投资	151,110,807.42
债券投资	23,540.77
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	151,134,348.19

6.4.7.20 其他收入

本基金于本报告期内无其他收入。

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	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	490.00
其他	5,295.83
合计	84,137.11

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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	4,486,115.37	4,339,510.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	—	—
应支付基金管理人的净管理费	4,486,115.37	4,339,510.23

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 1.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.10\% / \text{当年天数}$$

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	815,657.35	789,001.92

注：支付基金托管行兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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

基金管理人于本报告期内及上年度可比期间内未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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	625,000,000.00	96.9805	625,000,000.00	99.9997

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
兴业银行	20,692,650.79	29,935.44	16,346,238.63	71,753.41

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	锁定期股票	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	锁定期股票	10.11	10.11	29,986	303,158.46	303,158.46	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	12,851	129,923.61	129,923.61	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	锁定期股票	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	锁定期股票	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	锁定期股票	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	锁定期股票	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期股票	10.12	27.73	4,918	49,770.16	136,376.14	-
301513	尚水	2026 年 4	6 个月	锁定期股	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

	智能	月 10 日		票						
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	锁定期股票	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	锁定期股票	46.08	463.33	1,150	52,992.00	532,829.50	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	锁定期股票	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	锁定期股票	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	锁定期股票	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	锁定期股票	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	锁定期股票	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	锁定期股票	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	锁定期股票	11.18	17.59	720	8,049.60	12,664.80	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	锁定期股票	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰	2026 年 4	6 个月	锁定期股	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

	克	月 9 日		票						
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	锁定期股票	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	锁定期股票	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	锁定期股票	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	锁定期股票	17.52	35.92	234	4,099.68	8,405.28	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	锁定期股票	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	锁定期股票	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	锁定期股票	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	锁定期股票	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	锁定期股票	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	锁定期股票	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科	2026 年 2	6 个月	锁定期股	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-

	蓝天	月 3 日		票						
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	锁定期股票	19.68	141.49	1,086	21,372.48	153,658.14	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、受限期为流通受限证券原始受限期。

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 7 月 13 日	890.99	8,100	6,146,260.10	7,124,193.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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

本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常投资管理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以上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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，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	41,067,475.89	35,915,275.89
合计	41,067,475.89	35,915,275.89

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、短期未评级债券为国债。

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	-	-
AAA 以下	-	1,014,990.27
未评级	-	-
合计	-	1,014,990.27

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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 2026 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 2026 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。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金和债券投资。

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	20,692,650.79	-	-	-	20,692,650.79
结算备付金	4,462,755.87	-	-	-	4,462,755.87
存出保证金	386,069.90	-	-	-	386,069.90
交易性金融资产	41,067,475.89	-	-	970,408,305.32	1,011,475,781.21
应收股利	-	-	-	183,257.58	183,257.58
应收清算款	-	-	-	8,706,448.20	8,706,448.20
资产总计	66,608,952.45	-	-	979,298,011.10	1,045,906,963.55
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	865,180.81	865,180.81
应付托管费	-	-	-	157,305.60	157,305.60
应交税费	-	-	-	815.68	815.68
其他负债	-	-	-	1,270,776.89	1,270,776.89
负债总计	-	-	-	2,294,078.98	2,294,078.98
利率敏感度缺口	66,608,952.45	-	-	977,003,932.12	1,043,612,884.57
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	14,691,338.71	-	-	-	14,691,338.71
结算备付金	1,585,911.25	-	-	-	1,585,911.25
存出保证金	553,005.68	-	-	-	553,005.68
交易性金融资产	36,930,266.16	-	-	694,176,928.06	731,107,194.22
应收股利	-	-	-	19,133.02	19,133.02
应收清算款	-	-	-	4,475,761.51	4,475,761.51
资产总计	53,760,521.80	-	-	698,671,822.59	752,432,344.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	670,896.21	670,896.21

应付托管费	-	-	-	121,981.16	121,981.16
应付清算款	-	-	-	1,204,933.99	1,204,933.99
应交税费	-	-	-	7.62	7.62
其他负债	-	-	-	971,978.58	971,978.58
负债总计	-	-	-	2,969,797.56	2,969,797.56
利率敏感度缺口	53,760,521.80	-	-	695,702,025.03	749,462,546.83

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.94%（2025 年 12 月 31 日：4.93%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	162,507,928.98	-	162,507,928.98
应收股利	-	183,257.58	-	183,257.58
资产合计	-	162,691,186.56	-	162,691,186.56
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	162,691,186.56	-	162,691,186.56
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			

	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	133,612,821.46	-	133,612,821.46
应收股利	-	19,133.02	-	19,133.02
资产合计	-	133,631,954.48	-	133,631,954.48
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	133,631,954.48	-	133,631,954.48

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	8,134,559.33	6,681,597.72
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-8,134,559.33	-6,681,597.72

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其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 80%-95%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前 15 个工作日、开放期及开放期结束后 15 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；开放期内，本基金每个交易日日终扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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	970,408,305.32	92.99	694,176,928.06	92.62
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	970,408,305.32	92.99	694,176,928.06	92.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	87,973,766.46	62,748,936.04
	沪深 300 指数下降 5%	-87,973,766.46	-62,748,936.04

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	961,063,411.59	689,552,465.13
第二层次	48,624,750.96	40,832,776.46
第三层次	1,787,618.66	721,952.63
合计	1,011,475,781.21	731,107,194.22

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

于本报告期末，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：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其

账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本基金本报告期末,无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	970,408,305.32	92.78
	其中：股票	970,408,305.32	92.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,067,475.89	3.93
	其中：债券	41,067,475.89	3.93
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,155,406.66	2.41
8	其他各项资产	9,275,775.68	0.89
9	合计	1,045,906,963.55	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	113,600.00	0.01
B	采矿业	2,996,722.09	0.29
C	制造业	772,516,905.05	74.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,466,411.07	0.14
E	建筑业	3,843.00	0.00
F	批发和零售业	4,219,150.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	1,456.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,213,180.25	2.32
J	金融业	1,795,428.00	0.17
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	20,767.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	29,168.88	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	518,083.00	0.05
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	3,320.00	0.00
S	综合	2,342.00	0.00
	合计	807,900,376.34	77.41

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	16,128.97	0.00
日常消费品	-	-
能源	479,873.88	0.05
金融	-	-
医疗保健	4,491,385.44	0.43
工业	64,359.56	0.01
信息技术	155,694,501.16	14.92
通信服务	132,280.17	0.01
公用事业	1,629,399.80	0.16
房地产	-	-
合计	162,507,928.98	15.57

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	01347	华虹宏力	547,000	102,240,842.12	9.80
2	300308	中际旭创	75,800	96,266,000.00	9.22
3	300502	新易盛	143,780	87,274,460.00	8.36
4	002384	东山精密	210,900	55,329,615.00	5.30
5	00981	中芯国际	572,000	44,414,867.64	4.26
5	688981	中芯国际	2,000	317,640.00	0.03
6	603119	浙江荣泰	467,000	30,980,780.00	2.97
7	002463	沪电股份	176,000	26,892,800.00	2.58
8	688525	佰维存储	51,700	25,577,541.00	2.45
9	600183	生益科技	125,700	21,796,380.00	2.09
10	002353	杰瑞股份	142,700	21,761,750.00	2.09
11	300394	天孚通信	70,000	21,187,600.00	2.03
12	600487	亨通光电	189,000	20,665,260.00	1.98
13	300390	天华新能	204,700	19,141,497.00	1.83

14	688630	芯碁微装	34,400	18,899,016.00	1.81
15	603256	宏和科技	70,000	18,573,100.00	1.78
16	300750	宁德时代	42,700	16,781,527.00	1.61
17	603986	兆易创新	19,400	15,811,000.00	1.52
18	688256	寒武纪	9,633	15,369,933.15	1.47
19	603083	剑桥科技	57,000	14,527,590.00	1.39
20	002281	光迅科技	55,900	14,362,946.00	1.38
21	600176	中国巨石	167,700	12,221,976.00	1.17
22	000408	藏格矿业	170,000	11,784,400.00	1.13
23	300604	长川科技	28,700	9,798,754.00	0.94
24	688498	源杰科技	5,143	9,699,698.00	0.93
25	002916	深南电路	20,400	9,341,160.00	0.90
26	00992	联想集团	450,000	8,997,309.45	0.86
27	300408	三环集团	50,700	8,461,830.00	0.81
28	300620	光库科技	21,700	8,206,940.00	0.79
29	688147	微导纳米	46,900	7,592,172.00	0.73
30	688668	鼎通科技	20,000	7,466,000.00	0.72
31	688072	拓荆科技	8,100	7,124,193.00	0.68
32	000657	中钨高新	67,000	6,413,240.00	0.61
33	600549	厦门钨业	75,000	6,390,000.00	0.61
34	688012	中微公司	12,900	6,043,650.00	0.58
35	688313	仕佳光子	28,700	5,299,455.00	0.51
36	688048	长光华芯	10,000	5,020,000.00	0.48
37	002008	大族激光	33,000	4,953,630.00	0.47
38	601869	长飞光纤	9,000	4,913,100.00	0.47
39	300274	阳光电源	29,700	4,722,894.00	0.45
40	300567	精测电子	14,500	4,605,200.00	0.44
41	300475	香农芯创	14,000	4,200,000.00	0.40
42	688766	普冉股份	5,200	3,986,320.00	0.38
43	601233	桐昆股份	180,000	3,897,000.00	0.37
44	001309	德明利	4,000	3,771,600.00	0.36
45	688041	海光信息	9,783	3,622,644.90	0.35
46	601138	工业富联	47,000	3,391,050.00	0.32
47	600869	远东股份	100,000	3,347,000.00	0.32
48	002371	北方华创	3,700	3,272,872.00	0.31
49	600105	永鼎股份	46,700	3,151,316.00	0.30
50	688195	腾景科技	14,880	2,865,590.40	0.27
51	001389	广合科技	12,000	2,847,000.00	0.27
52	688808	联讯仪器	1,263	2,812,808.79	0.27
53	688702	盛科通信	7,000	2,729,930.00	0.26
54	688521	芯原股份	7,000	2,597,980.00	0.25
55	002222	福晶科技	27,300	2,519,244.00	0.24
56	300570	太辰光	10,000	2,467,100.00	0.24

57	688396	华润微	23,100	2,253,405.00	0.22
58	002409	雅克科技	9,700	2,177,650.00	0.21
59	688008	澜起科技	7,000	2,169,300.00	0.21
60	688120	华海清科	6,580	2,119,944.40	0.20
61	300870	欧陆通	6,040	2,087,967.60	0.20
62	688110	东芯股份	10,000	2,037,000.00	0.20
63	002138	顺络电子	27,000	1,973,700.00	0.19
64	06990	科伦博泰生物	5,000	1,894,307.55	0.18
65	301526	国际复材	40,000	1,866,800.00	0.18
66	688519	南亚新材	4,700	1,786,188.00	0.17
67	688146	中船特气	5,100	1,784,949.00	0.17
68	01816	中广核电力	700,000	1,629,399.80	0.16
69	688052	纳芯微	5,400	1,556,874.00	0.15
70	688502	茂莱光学	2,200	1,525,920.00	0.15
71	301511	德福科技	10,000	1,438,500.00	0.14
72	002993	奥海科技	20,000	1,432,200.00	0.14
73	300059	东方财富	69,900	1,424,562.00	0.14
74	688172	燕东微	17,000	1,422,220.00	0.14
75	002001	新 和 成	47,000	1,335,740.00	0.13
76	301468	博盈特焊	32,000	1,334,720.00	0.13
77	688478	晶升股份	14,700	1,301,685.00	0.12
78	000333	美的集团	17,000	1,284,010.00	0.12
79	301377	鼎泰高科	2,200	1,211,980.00	0.12
80	600522	中天科技	19,700	1,195,396.00	0.11
81	002025	航天电器	15,000	1,143,300.00	0.11
82	000988	华工科技	5,700	1,052,277.00	0.10
83	002837	英维克	13,000	1,034,280.00	0.10
84	300285	国瓷材料	10,000	1,031,800.00	0.10
85	601899	紫金矿业	40,000	1,005,600.00	0.10
86	300661	圣邦股份	7,000	1,004,360.00	0.10
87	688249	晶合集成	17,000	1,003,510.00	0.10
88	301205	联特科技	3,000	1,002,300.00	0.10
89	02268	药明合联	20,000	991,015.55	0.09
90	002436	兴森科技	19,000	968,050.00	0.09
91	300054	鼎龙股份	9,000	953,730.00	0.09
92	688337	普源精电	12,700	951,611.00	0.09
93	600236	桂冠电力	100,000	878,000.00	0.08
94	000636	风华高科	12,000	866,880.00	0.08
95	003031	中瓷电子	4,700	847,410.00	0.08
96	600309	万华化学	12,200	834,602.00	0.08
97	002156	通富微电	10,000	758,700.00	0.07
98	300548	长芯博创	2,700	750,600.00	0.07
99	000700	模塑科技	47,000	693,720.00	0.07

100	300476	胜宏科技	2,000	692,860.00	0.07
101	01801	信达生物	10,000	691,365.80	0.07
102	688652	京仪装备	3,400	680,578.00	0.07
103	688820	盛合晶微	3,786	676,405.14	0.06
104	603308	应流股份	10,000	604,000.00	0.06
105	600276	恒瑞医药	11,000	572,440.00	0.05
105	01276	恒瑞医药	200	10,049.12	0.00
106	688025	杰普特	1,200	564,000.00	0.05
107	301666	大普微	1,150	532,829.50	0.05
108	002938	鹏鼎控股	5,000	526,900.00	0.05
109	603061	金海通	1,000	502,220.00	0.05
110	01171	兖矿能源	50,000	479,873.88	0.05
110	600188	兖矿能源	1,000	17,770.00	0.00
111	688300	联瑞新材	2,000	488,800.00	0.05
112	603993	洛阳钼业	27,000	473,850.00	0.05
113	688301	奕瑞科技	3,780	468,720.00	0.04
114	301183	东田微	1,700	450,279.00	0.04
115	001248	华润新能源	42,837	433,082.07	0.04
116	688047	龙芯中科	2,700	417,609.00	0.04
117	301486	致尚科技	2,000	416,640.00	0.04
118	603688	石英股份	5,000	413,050.00	0.04
119	002119	康强电子	10,000	399,200.00	0.04
120	002602	世纪华通	27,000	380,700.00	0.04
121	300001	特锐德	10,000	378,300.00	0.04
122	000426	兴业银锡	10,000	329,600.00	0.03
123	600938	中国海油	12,000	325,800.00	0.03
124	688777	中控技术	2,700	317,250.00	0.03
125	03759	康龙化成	20,000	317,020.75	0.03
126	688691	灿芯股份	2,700	313,011.00	0.03
127	688141	杰华特	2,000	307,000.00	0.03
128	600301	华锡有色	5,000	306,600.00	0.03
129	06160	百济神州	2,000	296,001.84	0.03
130	605376	博迁新材	1,000	271,300.00	0.03
131	688027	国盾量子	500	252,005.00	0.02
132	000888	峨眉山 A	27,000	241,380.00	0.02
133	000683	博源化工	41,000	236,160.00	0.02
134	01530	三生制药	15,000	220,047.14	0.02
135	002128	电投能源	9,500	219,640.00	0.02
136	601100	恒立液压	2,000	215,120.00	0.02
137	002484	江海股份	2,000	210,000.00	0.02
138	600584	长电科技	2,000	207,100.00	0.02
139	688258	卓易信息	1,700	201,518.00	0.02
140	603228	景旺电子	2,700	195,507.00	0.02

141	601939	建设银行	20,100	193,563.00	0.02
142	003021	兆威机电	2,200	192,170.00	0.02
143	603588	高能环境	10,000	192,000.00	0.02
144	603893	瑞芯微	1,000	188,360.00	0.02
145	000962	东方钽业	2,000	181,200.00	0.02
146	002517	恺英网络	11,000	178,750.00	0.02
147	002028	思源电气	1,000	173,000.00	0.02
148	000688	国城矿业	5,049	172,827.27	0.02
149	002738	中矿资源	2,700	159,273.00	0.02
150	688818	电科蓝天	2,168	153,872.03	0.01
151	600900	长江电力	5,700	150,879.00	0.01
152	002475	立讯精密	2,000	140,800.00	0.01
153	301308	江波龙	200	140,760.00	0.01
154	001399	惠科股份	4,918	136,376.14	0.01
155	688809	强一股份	216	134,568.00	0.01
156	688503	聚和材料	1,000	132,700.00	0.01
157	00941	中国移动	2,000	132,280.17	0.01
158	300969	恒帅股份	1,400	131,264.00	0.01
159	600141	兴发集团	2,700	126,819.00	0.01
160	688220	翱捷科技	1,000	124,320.00	0.01
161	002050	三花智控	2,700	118,341.00	0.01
162	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
163	002772	众兴菌业	10,000	113,600.00	0.01
164	603186	华正新材	500	112,650.00	0.01
165	688698	伟创电气	2,000	104,900.00	0.01
166	002414	高德红外	7,700	102,102.00	0.01
167	600926	杭州银行	7,000	101,150.00	0.01
168	002293	罗莱生活	10,000	98,900.00	0.01
169	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
170	688556	高测股份	7,000	92,960.00	0.01
171	603199	九华旅游	2,700	84,132.00	0.01
172	688017	绿的谐波	200	83,572.00	0.01
173	603179	新泉股份	1,580	78,447.00	0.01
174	603379	三美股份	1,000	75,890.00	0.01
175	300666	江丰电子	200	73,720.00	0.01
176	301396	宏景科技	220	72,952.00	0.01
177	000893	亚钾国际	1,700	69,513.00	0.01
178	300857	协创数据	200	67,980.00	0.01
179	600498	烽火通信	900	66,240.00	0.01
180	02162	康诺亚-B	1,000	61,449.91	0.01
181	600096	云天化	2,000	60,800.00	0.01
182	601288	农业银行	10,000	60,700.00	0.01
183	603296	华勤技术	800	59,416.00	0.01

184	300751	迈为股份	200	56,492.00	0.01
185	002558	巨人网络	2,000	55,120.00	0.01
186	06198	青岛港	10,000	54,718.65	0.01
187	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
188	603530	神马电力	1,000	50,900.00	0.00
189	688361	中科飞测	100	43,000.00	0.00
190	600879	航天电子	2,000	42,580.00	0.00
191	00522	ASMPT	200	41,481.95	0.00
192	600760	中航沈飞	1,000	41,100.00	0.00
193	603786	科博达	1,000	40,910.00	0.00
194	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
195	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
196	002850	科达利	200	37,860.00	0.00
197	300832	新产业	900	37,800.00	0.00
198	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
199	002465	海格通信	2,700	34,479.00	0.00
200	603009	北特科技	700	33,579.00	0.00
201	688049	炬芯科技	700	32,837.00	0.00
202	300373	扬杰科技	200	31,446.00	0.00
203	601698	中国卫通	1,000	30,250.00	0.00
204	001203	大中矿业	1,000	29,950.00	0.00
205	300672	国科微	100	29,500.00	0.00
206	002487	大金重工	500	28,985.00	0.00
207	603352	至信股份	1,115	28,966.33	0.00
208	600875	东方电气	1,000	28,770.00	0.00
209	600985	淮北矿业	2,000	28,100.00	0.00
210	601168	西部矿业	1,000	27,140.00	0.00
211	605228	神通科技	2,000	26,860.00	0.00
212	603950	长源东谷	300	25,329.00	0.00
213	688322	奥比中光	189	24,673.95	0.00
214	688591	泰凌微	700	24,066.00	0.00
215	600426	华鲁恒升	1,000	23,920.00	0.00
216	002648	卫星化学	1,000	23,490.00	0.00
217	688376	美埃科技	200	23,260.00	0.00
218	600482	中国动力	700	22,960.00	0.00
219	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
220	688513	苑东生物	500	21,980.00	0.00
221	605117	德业股份	200	21,236.00	0.00
222	688205	德科立	100	20,819.00	0.00
223	600989	宝丰能源	1,000	20,330.00	0.00
224	600415	小商品城	2,000	20,320.00	0.00
225	300946	恒而达	500	19,695.00	0.00
226	603663	三祥新材	200	19,260.00	0.00

227	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
228	688308	欧科亿	100	18,181.00	0.00
229	301611	珂玛科技	100	18,007.00	0.00
230	003020	立方制药	1,200	17,772.00	0.00
231	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
232	300442	润泽科技	200	16,614.00	0.00
233	600397	江钨装备	600	16,338.00	0.00
234	09988	阿里巴巴-W	200	16,128.97	0.00
235	301306	西测测试	100	15,849.00	0.00
236	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
237	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
238	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
239	603175	超颖电子	169	15,056.21	0.00
240	600699	均胜电子	692	14,954.12	0.00
241	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
242	000977	浪潮信息	200	14,000.00	0.00
243	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
244	000801	四川九洲	1,000	12,940.00	0.00
245	601112	振石股份	720	12,664.80	0.00
246	688805	健信超导	265	12,447.05	0.00
247	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
248	300136	信维通信	100	11,925.00	0.00
249	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
250	688266	泽璟制药	100	11,666.00	0.00
251	000983	山西焦煤	2,000	11,600.00	0.00
252	002518	科士达	200	10,718.00	0.00
253	688213	思特威	100	10,707.00	0.00
254	300747	锐科激光	200	10,618.00	0.00
255	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
256	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
257	603606	东方电缆	240	9,962.40	0.00
258	002126	银轮股份	200	9,960.00	0.00
259	301517	陕西华达	200	9,926.00	0.00
260	03996	中国能源建设	10,000	9,640.91	0.00
261	002064	华峰化学	1,000	9,490.00	0.00
262	06821	凯莱英	100	9,449.82	0.00
263	688102	斯瑞新材	200	9,436.00	0.00
264	300803	指南针	100	9,167.00	0.00
265	301550	斯菱智驱	100	9,143.00	0.00
266	688500	慧辰股份	200	9,066.00	0.00
267	688615	合合信息	80	9,048.00	0.00
268	000973	佛塑科技	600	8,610.00	0.00
269	000960	锡业股份	200	8,538.00	0.00

270	688676	金盘科技	100	8,464.00	0.00
271	688712	北芯生命	234	8,405.28	0.00
272	688210	统联精密	200	8,102.00	0.00
273	002594	比亚迪	100	7,970.00	0.00
274	002426	胜利精密	2,000	7,960.00	0.00
275	688403	汇成股份	200	7,940.00	0.00
276	002223	鱼跃医疗	300	7,698.00	0.00
277	002609	捷顺科技	1,000	7,620.00	0.00
278	002532	天山铝业	700	7,511.00	0.00
279	300478	杭州高新	200	7,338.00	0.00
280	300378	鼎捷数智	200	7,220.00	0.00
281	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
282	000157	中联重科	1,000	6,970.00	0.00
283	002812	恩捷股份	100	6,691.00	0.00
284	688290	景业智能	100	6,636.00	0.00
285	301525	儒竞科技	140	6,609.40	0.00
286	002460	赣锋锂业	100	6,540.00	0.00
287	300014	亿纬锂能	100	6,503.00	0.00
288	688651	盛邦安全	200	6,444.00	0.00
289	001221	悍高集团	160	6,435.20	0.00
290	002466	天齐锂业	100	6,132.00	0.00
291	301449	天溯计量	157	6,075.90	0.00
292	300316	晶盛机电	100	6,040.00	0.00
293	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.00
294	002865	钧达股份	100	5,968.00	0.00
295	688516	奥特维	100	5,739.00	0.00
296	605060	联德股份	100	5,674.00	0.00
297	601689	拓普集团	100	5,642.00	0.00
298	600595	中孚实业	1,000	5,620.00	0.00
299	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
300	001306	夏厦精密	100	5,457.00	0.00
301	688778	厦钨新能	100	5,440.00	0.00
302	300433	蓝思科技	100	5,366.00	0.00
303	688063	派能科技	100	5,327.00	0.00
304	300624	万兴科技	100	5,187.00	0.00
305	688114	华大智造	100	5,108.00	0.00
306	002407	多氟多	100	5,023.00	0.00
307	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
308	300347	泰格医药	100	4,800.00	0.00
309	301382	蜂助手	100	4,600.00	0.00
310	600027	华电国际	1,000	4,450.00	0.00
311	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.00
312	600219	南山铝业	1,000	3,990.00	0.00

313	301161	唯万密封	100	3,861.00	0.00
314	605598	上海港湾	100	3,843.00	0.00
315	300007	汉威科技	100	3,820.00	0.00
316	300785	值得买	100	3,667.00	0.00
317	000738	航发控制	200	3,658.00	0.00
318	001360	南矿集团	200	3,538.00	0.00
319	601595	上海电影	200	3,320.00	0.00
320	603011	合锻智能	100	3,308.00	0.00
321	600171	上海贝岭	100	3,194.00	0.00
322	002430	杭氧股份	100	3,096.00	0.00
323	301638	南网数字	122	2,934.10	0.00
324	601601	中国太保	100	2,852.00	0.00
325	000963	华东医药	100	2,812.00	0.00
326	600066	宇通客车	100	2,681.00	0.00
327	603166	福达股份	200	2,674.00	0.00
328	600988	赤峰黄金	100	2,632.00	0.00
329	601360	三六零	300	2,607.00	0.00
330	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
331	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
332	000833	粤桂股份	100	2,342.00	0.00
333	000603	盛达资源	100	2,310.00	0.00
334	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
335	688221	前沿生物	100	2,240.00	0.00
336	601069	西部黄金	100	2,200.00	0.00
337	002657	中科金财	100	2,183.00	0.00
338	688472	阿特斯	200	2,164.00	0.00
339	600562	国睿科技	100	2,122.00	0.00
340	601225	陕西煤业	100	2,035.00	0.00
341	688387	信科移动	100	1,984.00	0.00
342	002534	西子洁能	100	1,855.00	0.00
343	600346	恒力石化	100	1,771.00	0.00
344	603926	铁流股份	100	1,769.00	0.00
345	000975	山金国际	100	1,700.00	0.00
346	603977	国泰集团	100	1,651.00	0.00
347	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
348	600596	新安股份	100	1,596.00	0.00
349	300525	博思软件	200	1,488.00	0.00
350	300413	芒果超媒	100	1,463.00	0.00
351	600131	国网信通	100	1,460.00	0.00
352	000099	中信海直	100	1,456.00	0.00
353	603915	国茂股份	100	1,419.00	0.00
354	000559	万向钱潮	100	1,293.00	0.00
355	300118	东方日升	100	1,245.00	0.00

355	600927	永安期货	100	1,245.00	0.00
356	601898	中煤能源	100	1,218.00	0.00
357	000830	鲁西化工	100	1,200.00	0.00
358	600909	华安证券	100	1,111.00	0.00
359	600919	江苏银行	100	1,078.00	0.00
360	600589	大位科技	100	1,024.00	0.00
361	000957	中通客车	100	936.00	0.00
362	002351	漫步者	100	909.00	0.00
363	600356	恒丰纸业	100	741.00	0.00
364	600718	东软集团	100	724.00	0.00
365	01177	中国生物制药	177	677.96	0.00
366	601003	柳钢股份	200	674.00	0.00
367	300737	科顺股份	100	657.00	0.00
368	002100	天康生物	100	631.00	0.00
369	600409	三友化工	100	611.00	0.00
370	002627	三峡旅游	100	571.00	0.00
371	600398	海澜之家	100	523.00	0.00
372	002010	传化智联	100	447.00	0.00
373	600010	包钢股份	100	223.00	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	603119	浙江荣泰	53,653,609.50	7.16
2	00981	中芯国际	48,625,455.36	6.49
2	688981	中芯国际	2,112,850.00	0.28
3	002384	东山精密	48,917,365.00	6.53
4	300394	天孚通信	45,954,786.00	6.13
5	300502	新易盛	40,929,603.00	5.46
6	600426	华鲁恒升	38,283,354.09	5.11
7	688072	拓荆科技	34,500,717.45	4.60
8	688702	盛科通信	31,681,122.17	4.23
9	688525	佰维存储	31,651,015.40	4.22
10	300390	天华新能	30,839,459.00	4.11
11	688256	寒武纪	30,189,023.24	4.03
12	603296	华勤技术	29,569,178.50	3.95
13	300750	宁德时代	28,070,989.00	3.75
14	688041	海光信息	27,340,781.12	3.65
15	002475	立讯精密	25,814,340.00	3.44
16	002281	光迅科技	23,088,427.00	3.08
17	603799	华友钴业	22,582,326.30	3.01
18	002353	杰瑞股份	21,806,006.00	2.91

19	688012	中微公司	21,331,224.69	2.85
20	01347	华虹宏力	21,032,381.96	2.81
21	002001	新 和 成	20,492,756.56	2.73
22	600183	生益科技	19,457,210.00	2.60
23	600309	万华化学	19,084,714.00	2.55
24	300751	迈为股份	18,784,593.00	2.51
25	600343	航天动力	18,650,419.00	2.49
26	688521	芯原股份	17,739,076.33	2.37
27	603083	剑桥科技	17,722,319.00	2.36
28	002463	沪电股份	17,296,665.00	2.31
29	600487	亨通光电	17,015,266.00	2.27
30	00992	联想集团	16,871,224.31	2.25
31	600584	长电科技	16,492,507.00	2.20
32	002916	深南电路	16,431,948.00	2.19
33	002465	海格通信	16,041,188.00	2.14
34	002545	东方铁塔	15,756,370.00	2.10
35	300476	胜宏科技	15,374,095.00	2.05
36	603986	兆易创新	15,072,411.00	2.01

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	603119	浙江荣泰	63,571,086.58	8.48
2	688072	拓荆科技	48,048,667.13	6.41
3	300502	新易盛	43,164,383.80	5.76
4	00981	中芯国际	36,449,164.62	4.86
4	688981	中芯国际	1,932,245.42	0.26
5	603799	华友钴业	38,159,451.00	5.09
6	603993	洛阳钼业	32,900,640.00	4.39
6	03993	洛阳钼业	4,325,283.94	0.58
7	688256	寒武纪	36,726,322.37	4.90
8	600426	华鲁恒升	36,173,377.42	4.83
9	300308	中际旭创	30,544,257.00	4.08
10	603296	华勤技术	29,966,767.80	4.00
11	300394	天孚通信	29,305,609.60	3.91
12	000408	藏格矿业	28,188,799.00	3.76
13	688041	海光信息	28,014,140.89	3.74
14	002475	立讯精密	27,136,014.00	3.62
15	688702	盛科通信	26,908,555.18	3.59
16	002463	沪电股份	25,665,937.42	3.42
17	01347	华虹宏力	25,044,326.33	3.34
17	688347	华虹宏力	23,000.00	0.00

18	300476	胜宏科技	23,773,876.00	3.17
19	300751	迈为股份	23,504,535.00	3.14
20	09988	阿里巴巴-W	23,104,445.87	3.08
21	300390	天华新能	22,998,670.12	3.07
22	02259	紫金黄金国际	22,985,497.73	3.07
23	688012	中微公司	22,248,379.58	2.97
24	688525	佰维存储	20,474,149.48	2.73
25	605090	九丰能源	20,029,549.00	2.67
26	002001	新 和 成	18,180,110.00	2.43
27	01801	信达生物	17,855,842.14	2.38
28	300750	宁德时代	17,452,075.86	2.33
29	600309	万华化学	17,451,354.00	2.33
30	600343	航天动力	17,346,741.00	2.31
31	600584	长电科技	17,007,213.00	2.27
32	002465	海格通信	16,725,950.00	2.23
33	00175	吉利汽车	16,056,701.93	2.14
34	688521	芯原股份	15,954,438.22	2.13
35	001203	大中矿业	15,805,981.00	2.11
36	02359	药明康德	12,983,252.74	1.73
36	603259	药明康德	2,102,687.00	0.28

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	2,284,032,637.63
卖出股票收入（成交）总额	2,283,602,388.24

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	41,067,475.89	3.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	41,067,475.89	3.94

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	019835	26 国债 09	410,000	41,067,475.89	3.94

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。本基金将构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	386,069.90
2	应收清算款	8,706,448.20
3	应收股利	183,257.58
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	9,275,775.68

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
221	2,916,107.02	644,459,651.31	100.0000	-	-

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	100.00

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	625,000,000.00	96.9805	625,000,000.00	96.9805	3 年
其他	-	-	-	-	-
合计	625,000,000.00	96.9805	625,000,000.00	96.9805	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 8 月 25 日）基金份额总额	1,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	625,002,148.20
本报告期基金总申购份额	19,457,503.11
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	644,459,651.31

§ 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

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及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

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中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

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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(%)	
中银国际证券	1	685,144,406.01	15.01	308,315.44	14.84	-
方正证券	2	627,461,306.39	13.74	285,246.18	13.73	-
华创证券	2	616,670,201.63	13.51	281,120.69	13.53	-
财通证券	1	476,393,165.10	10.44	219,114.40	10.55	-
招商证券	1	466,371,378.	10.22	213,129.06	10.26	-

		11				
长江证券	2	413,456,417.78	9.06	188,282.34	9.06	-
申万宏源证券	2	217,246,043.37	4.76	98,607.71	4.75	-
东吴证券	1	185,919,419.59	4.07	86,117.17	4.15	-
中金公司	1	154,326,194.62	3.38	69,446.88	3.34	-
华源证券	1	121,931,831.49	2.67	54,869.43	2.64	-
国投证券	2	116,795,837.31	2.56	53,600.10	2.58	-
天风证券	1	104,179,801.50	2.28	46,880.96	2.26	-
华福证券	2	82,488,189.40	1.81	37,506.52	1.81	-
国联民生证券	4	79,175,739.22	1.73	36,578.09	1.76	-
湘财证券	1	73,950,760.77	1.62	33,277.90	1.60	-
国泰海通证券	2	60,934,465.70	1.33	27,420.59	1.32	-
广发证券	1	41,809,627.72	0.92	18,814.39	0.91	-
银河证券	2	40,821,053.14	0.89	18,820.92	0.91	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

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。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。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增租用华源证券 1 个交易单元。

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 (%)
中银国际 证券	31,416.00	0.04	-	-	-	-

方正证券	77,817,470.00	96.96	-	-	-	-
华创证券	1,400,589.86	1.75	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	656,000.00	0.82	-	-	-	-
中金公司	348,134.00	0.43	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	1,370.00	0.00	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方 财富证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回等业务公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 15 日
2	太平智远三个月定期开放股票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
3	太平智远三个月定期开放股票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	太平智远三个月定期开放股票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	太平智远三个月定期开放股票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	太平智远三个月定期开放股票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	关于太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回等业务公告	中国证监会规定媒介	2026 年 5 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	625,000,000.00	-	-	625,000,000.00	96.9805

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、《太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平智远三个月定期开放股票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