

# 太平嘉裕债券型证券投资基金

## 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 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             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>37</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 37        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 37        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 38        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 48        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 49        |
| 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      | 50        |
| 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   | 50        |
| 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   | 50        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 50        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 50        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                      | 51        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>51</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 51        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 52        |
| 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 .....   | 52        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>52</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>53</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 53        |
| 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 .....   | 53        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 53        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 53        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 53        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 53        |
| 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 .....   | 54        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 55        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>55</b> |
| 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 ..... | 55        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 56        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>56</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 56        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 56        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 56        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                    |                  |
|---------------------|--------------------|------------------|
| 基金名称                | 太平嘉裕债券型证券投资基金      |                  |
| 基金简称                | 太平嘉裕债券             |                  |
| 基金主代码               | 024126             |                  |
| 基金运作方式              | 契约型开放式             |                  |
| 基金合同生效日             | 2025 年 9 月 23 日    |                  |
| 基金管理人               | 太平基金管理有限公司         |                  |
| 基金托管人               | 中国银行股份有限公司         |                  |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 1,384,004,475.97 份 |                  |
| 基金合同存续期             | 不定期                |                  |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 太平嘉裕债券 A           | 太平嘉裕债券 C         |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 024126             | 024127           |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 1,253,884,711.61 份 | 130,119,764.36 份 |

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，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。                                                                                                                                                                                                                            |
| 投资策略   | 本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求降低信用风险，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益。本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态对债券投资组合进行调整。在股票投资中，本基金主要通过量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票，在严格控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率*90%+中证 A500 指数收益率*10%                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，一般而言，其预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。                                                                                                                                   |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目   |    | 基金管理人      | 基金托管人      |
|------|----|------------|------------|
| 名称   |    | 太平基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名 | 赵霖         | 许俊         |

|        |      |                                      |                           |
|--------|------|--------------------------------------|---------------------------|
| 负责人    | 联系电话 | 021-38556613                         | 010-66596688              |
|        | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn           | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话 |      | 021-61560999/400-028-8699            | 95566                     |
| 传真     |      | 021-38556677                         | 010-66594942              |
| 注册地址   |      | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室            | 北京市西城区复兴门内大街 1 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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号          |
| 邮政编码   |      | 200120                               | 100818                    |
| 法定代表人  |      | 刘冬                                   | 葛海蛟                       |

## 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<br>和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日) |              |
|-------------------|---------------------------------------|--------------|
|                   | 太平嘉裕债券 A                              | 太平嘉裕债券 C     |
| 本期已实现收益           | 39,337,455.62                         | 4,888,455.36 |
| 本期利润              | 36,060,109.91                         | 4,569,706.06 |
| 加权平均基金份额本期利润      | 0.0323                                | 0.0347       |
| 本期加权平均净值利润率       | 3.13%                                 | 3.37%        |
| 本期基金份额净值增长率       | 3.11%                                 | 3.02%        |
| 3.1.2 期末数据<br>和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)                 |              |
|                   | 期末可供分配利润                              | 5,796,922.49 |
| 期末可供分配利润          | 57,925,834.59                         |              |

|              |                       |                |
|--------------|-----------------------|----------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0462                | 0.0446         |
| 期末基金资产净值     | 1,311,810,546.20      | 135,916,686.85 |
| 期末基金份额净值     | 1.0462                | 1.0446         |
| 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  | 4.62%                 | 4.46%          |

- 注：1、本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 23 日，截至本报告期末基金成立未满一年。
- 2、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。
- 3、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）。
- 4、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

太平嘉裕债券 A

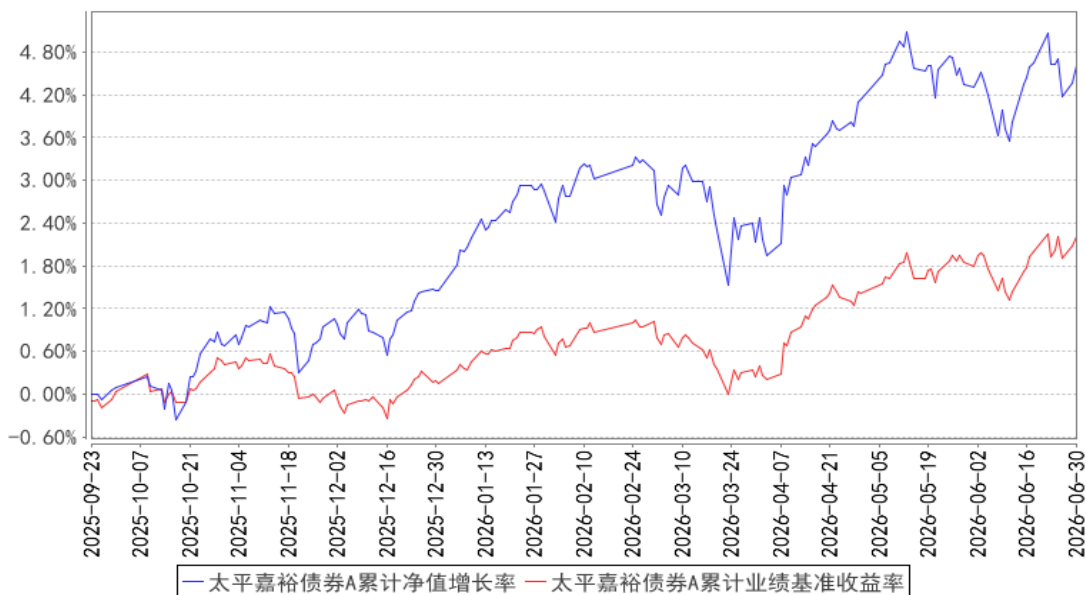
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③   | ②－④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 2.44%    | 0.25%       | 1.96%      | 0.15%         | 0.48% | 0.10% |
| 过去六个月      | 3.11%    | 0.24%       | 2.05%      | 0.14%         | 1.06% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.62%    | 0.22%       | 2.21%      | 0.13%         | 2.41% | 0.09% |

太平嘉裕债券 C

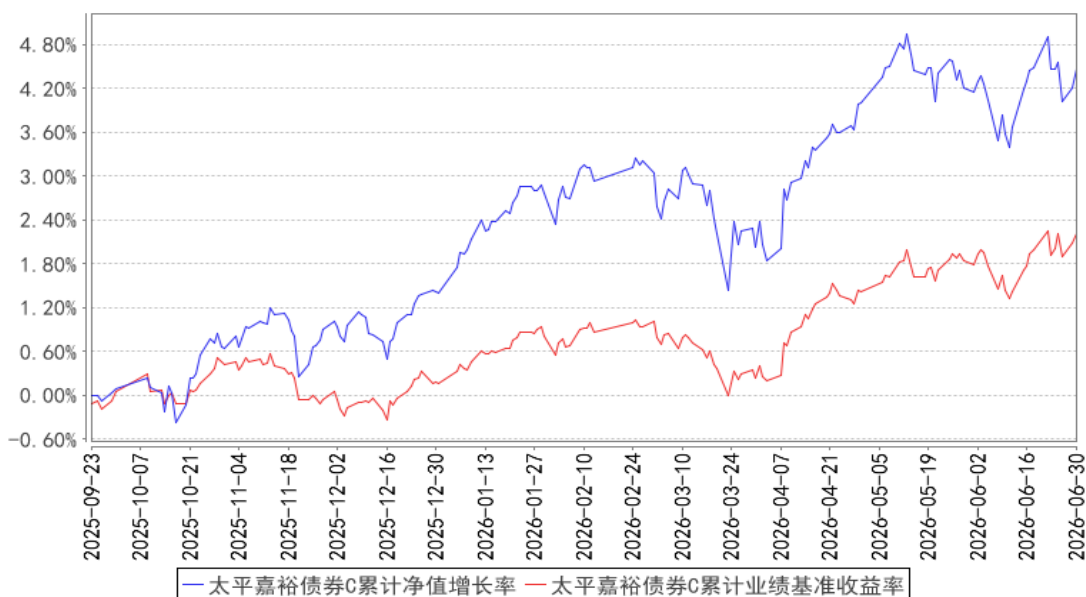
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③   | ②－④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月      | 2.39%    | 0.25%       | 1.96%      | 0.15%         | 0.43% | 0.10% |
| 过去六个月      | 3.02%    | 0.24%       | 2.05%      | 0.14%         | 0.97% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.46%    | 0.22%       | 2.21%      | 0.13%         | 2.25% | 0.09% |

### 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

太平嘉裕债券A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



太平嘉裕债券C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 2025 年 09 月 23 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未  
满一年。本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监  
督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海



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

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 韩聪  | 多元资产投资部助理总监、本基金的基金经理 | 2025 年 9 月 23 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。                                                                                                                                                      |
| 张子权 | 本基金的基金经理             | 2025 年 9 月 23 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。 |
|--|--|--|--|--|-------------|

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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，太平嘉裕债券 A 份额净值增长率为 3.11%，同期业绩比较基准收益率为 2.05%；太平嘉裕债券 C 份额净值增长率为 3.02%，同期业绩比较基准收益率为 2.05%。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在太平嘉裕债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

### § 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：太平嘉裕债券型证券投资基金

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<br>2026 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6. 4. 7. 1 | 20, 717, 454. 39               | 128, 893, 539. 54                |
| 结算备付金         |            | 4, 293, 049. 69                | 16, 007, 365. 67                 |
| 存出保证金         |            | 107, 580. 23                   | 139, 991. 07                     |
| 交易性金融资产       | 6. 4. 7. 2 | 1, 625, 165, 959. 99           | 1, 507, 279, 102. 08             |
| 其中：股票投资       |            | 266, 922, 297. 70              | 281, 095, 860. 83                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 1, 358, 243, 662. 29           | 1, 226, 183, 241. 25             |
| 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 | 30, 000, 000. 00               | -                                |
| 债权投资          | 6. 4. 7. 5 | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        | 6. 4. 7. 6 | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      | 6. 4. 7. 7 | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | 257, 491. 61                   | 7, 489, 864. 46                  |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 6, 412. 95                     | 97, 951. 02                      |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6. 4. 7. 8 | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 1, 680, 547, 948. 86           | 1, 659, 907, 813. 84             |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |                                  |
| 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     |            | 223, 125, 682. 38              | 50, 006, 025. 10                 |
| 应付清算款         |            | 5, 165, 106. 15                | -                                |
| 应付赎回款         |            | 3, 580, 068. 80                | 86, 946, 569. 79                 |
| 应付管理人报酬       |            | 401, 239. 33                   | 528, 483. 06                     |
| 应付托管费         |            | 91, 711. 84                    | 120, 796. 14                     |
| 应付销售服务费       |            | 21, 787. 03                    | 71, 203. 90                      |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 58, 308. 93                    | 33, 128. 80                      |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |

|             |          |                  |                  |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 递延所得税负债     |          | -                | -                |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 376,811.35       | 606,457.20       |
| 负债合计        |          | 232,820,715.81   | 138,312,663.99   |
| <b>净资产：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 1,384,004,475.97 | 1,499,884,172.31 |
| 未分配利润       | 6.4.7.11 | 63,722,757.08    | 21,710,977.54    |
| 净资产合计       |          | 1,447,727,233.05 | 1,521,595,149.85 |
| 负债和净资产总计    |          | 1,680,547,948.86 | 1,659,907,813.84 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，太平嘉裕债券 A 份额净值 1.0462 元，基金份额总额 1,253,884,711.61 份，太平嘉裕债券 C 份额净值 1.0446 元，基金份额总额 130,119,764.36 份，总份额合计 1,384,004,475.97 份。

## 6.2 利润表

会计主体：太平嘉裕债券型证券投资基金

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|---------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | 45,393,844.94                         |
| 1. 利息收入                |            | 238,253.30                            |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.12   | 116,569.63                            |
| 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             |            | 121,683.67                            |
| 其他利息收入                 |            | -                                     |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 48,750,355.12                         |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.13   | 34,499,406.61                         |
| 基金投资收益                 |            | -                                     |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.14   | 12,400,640.93                         |
| 资产支持证券投资收益             | 6.4.7.15   | -                                     |
| 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   | 1,850,307.58                          |
| 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   | -3,596,095.01                         |
| 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   | 1,331.53                              |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 4,764,028.97                          |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 2,240,281.99                          |
| 其中：暂估管理人报酬             |            | -                                     |

|                     |                |                  |
|---------------------|----------------|------------------|
| 2. 托管费              | 6. 4. 10. 2. 2 | 512, 064. 39     |
| 3. 销售服务费            | 6. 4. 10. 2. 3 | 135, 587. 23     |
| 4. 投资顾问费            |                | -                |
| 5. 利息支出             |                | 1, 743, 687. 71  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |                | 1, 743, 687. 71  |
| 6. 信用减值损失           | 6. 4. 7. 21    | -                |
| 7. 税金及附加            |                | 21, 002. 71      |
| 8. 其他费用             | 6. 4. 7. 22    | 111, 404. 94     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |                | 40, 629, 815. 97 |
| 减：所得税费用             |                | -                |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |                | 40, 629, 815. 97 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |                | -                |
| 六、综合收益总额            |                | 40, 629, 815. 97 |

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 23 日，截至本报告期末基金成立未满一年，无上年度可比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：太平嘉裕债券型证券投资基金

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<br>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                               | 1, 499, 884, 172. 31                  | 21, 710, 977. 54  | 1, 521, 595, 149. 85 |
| 二、本期期初净资产                               | 1, 499, 884, 172. 31                  | 21, 710, 977. 54  | 1, 521, 595, 149. 85 |
| 三、本期增减变动额<br>（减少以“-”号填列）                | -115, 879, 696. 34                    | 42, 011, 779. 54  | -73, 867, 916. 80    |
| （一）、综合收益总额                              | -                                     | 40, 629, 815. 97  | 40, 629, 815. 97     |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>（净资产减少以“-”号填列） | -115, 879, 696. 34                    | 1, 381, 963. 57   | -114, 497, 732. 77   |
| 其中：1. 基金申购款                             | 496, 944, 744. 31                     | 20, 708, 784. 80  | 517, 653, 529. 11    |
| 2. 基金赎回款                                | -612, 824, 440. 65                    | -19, 326, 821. 23 | -632, 151, 261. 88   |
| （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               | 1,384,004,475.97 | 63,722,757.08 | 1,447,727,233.05 |

注：本基金基金合同生效日为 2025 年 09 月 23 日，截至本报告期末基金成立未满一年，无上年度可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| <u>熊莹</u> | <u>史彦刚</u> | <u>王瑞瑾</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人    |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平嘉裕债券型证券投资基金(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[2025]749 号《关于准予太平嘉裕债券型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《太平嘉裕债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 1,799,122,453.48 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，《太平嘉裕债券型证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,799,255,716.06 份，其中认购资金利息折合 133,262.58 份基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平嘉裕债券型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、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及存托凭证)、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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资股票、可转换债券和可交换债券合计不低于基金资产的 5%且不超过基金资产的 20%(其中，境内股票资产的投资比例不低于基金资产的 5%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*90%+中证 A500 指数收益率\*10%。

#### 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、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 20,717,454.39          |
| 等于：本金          | 20,714,514.48          |
| 加：应计利息         | 2,939.91               |
| 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             | 20,717,454.39          |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |               |                  |               |
|---------------|-------|------------------------|---------------|------------------|---------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 273,383,861.22         | -             | 266,922,297.70   | -6,461,563.52 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -             | -                | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 50,289,331.88          | 161,391.21    | 50,520,781.21    | 70,058.12     |
|               | 银行间市场 | 1,293,256,244.29       | 12,900,881.08 | 1,307,722,881.08 | 1,565,755.71  |
|               | 合计    | 1,343,545,576.17       | 13,062,272.29 | 1,358,243,662.29 | 1,635,813.83  |
| 资产支持证券        |       | -                      | -             | -                | -             |
| 基金            |       | -                      | -             | -                | -             |

|    |                  |               |                  |               |
|----|------------------|---------------|------------------|---------------|
| 其他 | -                | -             | -                | -             |
| 合计 | 1,616,929,437.39 | 13,062,272.29 | 1,625,165,959.99 | -4,825,749.69 |

#### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 30,000,000.00          | -         |
| 银行间市场 | -                      | -         |
| 合计    | 30,000,000.00          | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金于本报告期末未计提减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>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      | 297,468.19             |
| 其中：交易所市场    | 273,856.67             |
| 银行间市场       | 23,611.52              |
| 应付利息        | -                      |
| 预提信息披露费     | 59,507.37              |
| 预提审计费       | 19,835.79              |
| 合计          | 376,811.35             |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

太平嘉裕债券 A

| 项目            | 本期<br>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          | 1,249,677,269.64                      | 1,249,677,269.64 |
| 本期申购          | 392,872,674.58                        | 392,872,674.58   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -388,665,232.61                       | -388,665,232.61  |
| 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           | 1,253,884,711.61                      | 1,253,884,711.61 |

太平嘉裕债券 C

| 项目   | 本期<br>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 | 250,206,902.67                        | 250,206,902.67 |

|               |                 |                 |
|---------------|-----------------|-----------------|
| 本期申购          | 104,072,069.73  | 104,072,069.73  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -224,159,208.04 | -224,159,208.04 |
| 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           | 130,119,764.36  | 130,119,764.36  |

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

太平嘉裕债券 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 19,140,820.17  | -933,689.78   | 18,207,130.39  |
| 本期期初           | 19,140,820.17  | -933,689.78   | 18,207,130.39  |
| 本期利润           | 39,337,455.62  | -3,277,345.71 | 36,060,109.91  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,126,018.99   | -467,424.70   | 3,658,594.29   |
| 其中：基金申购款       | 16,174,839.15  | 338,458.62    | 16,513,297.77  |
| 基金赎回款          | -12,048,820.16 | -805,883.32   | -12,854,703.48 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 62,604,294.78  | -4,678,460.19 | 57,925,834.59  |

太平嘉裕债券 C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 上年度末           | 3,690,804.20  | -186,957.05 | 3,503,847.15  |
| 本期期初           | 3,690,804.20  | -186,957.05 | 3,503,847.15  |
| 本期利润           | 4,888,455.36  | -318,749.30 | 4,569,706.06  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,299,491.18 | 22,860.46   | -2,276,630.72 |
| 其中：基金申购款       | 4,207,304.02  | -11,816.99  | 4,195,487.03  |
| 基金赎回款          | -6,506,795.20 | 34,677.45   | -6,472,117.75 |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | 6,279,768.38  | -482,845.89 | 5,796,922.49  |

#### 6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 106,512.43                            |
| 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 | 9,766.28                              |
| 其他        | 290.92                                |
| 合计        | 116,569.63                            |

#### 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<br>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 | 34,499,406.61              |
| 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               | 34,499,406.61              |

##### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,411,110,214.01           |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,375,171,331.12           |
| 减：交易费用     | 1,439,476.28               |
| 买卖股票差价收入   | 34,499,406.61              |

##### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 12,761,064.57              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -360,423.64                |
| 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                           | 12,400,640.93              |

##### 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<br>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 | 207,841,125.20             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成  | 204,168,895.62             |

|          |              |
|----------|--------------|
| 本总额      |              |
| 减：应计利息总额 | 4,028,808.22 |
| 减：交易费用   | 3,845.00     |
| 买卖债券差价收入 | -360,423.64  |

#### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,850,307.58                          |
| 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            | 1,850,307.58                          |

#### 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -3,596,095.01                         |
| 股票投资                   | -6,553,314.33                         |
| 债券投资                   | 2,957,219.32                          |
| 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                     | -3,596,095.01                         |

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,331.53                              |
| 合计      | 1,331.53                              |

注：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。

#### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 19,835.79                             |
| 信息披露费 | 59,507.37                             |

|         |            |
|---------|------------|
| 证券出借违约金 | -          |
| 银行划款手续费 | 16,561.78  |
| 账户维护费   | 15,500.00  |
| 合计      | 111,404.94 |

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

本基金的基金管理人于 2026 年 8 月 1 日宣告 2026 年度第 1 次分红，向截至 2026 年 8 月 4 日止在本基金注册登记人太平基金管理有限公司登记在册的全体持有人，A 类基金份额按每 10 份基金份额派发红利 0.1330 元，C 类基金份额按每 10 份基金份额派发红利 0.1330 元。

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 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |
| 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 2,240,281.99                          |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 339,779.10                            |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,900,502.89                          |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 512,064.39                            |

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |            |            |
|----------------|---------------------------------------|------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                      |            |            |
|                | 太平嘉裕债券 A                              | 太平嘉裕债券 C   | 合计         |
| 太平基金           | —                                     | 3.10       | 3.10       |
| 中国银行           | —                                     | 123,216.15 | 123,216.15 |
| 合计             | —                                     | 123,219.25 | 123,219.25 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

### 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

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

太平嘉裕债券 A

| 关联方名称 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                         | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                         |
|-------|------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例（%） | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例（%） |
| 太平人寿  | 766,905,798.63         | 61.1624                 | 766,905,798.63           | 61.3683                 |

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |            |
|-------|---------------------------------------|------------|
|       | 期末余额                                  | 当期利息收入     |
| 中国银行  | 20,717,454.39                         | 106,512.43 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|----------------|--------|--------|------------|------------|----|
| 603137 | 恒尚节能 | 2026 年 6 月 16 日 | 重大事项停牌 | 12.94  | 2026 年 7 月 1 日 | 14.23  | 12,300 | 173,843.40 | 159,162.00 | -  |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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 223,125,682.38 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         |
|-----------|------------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 092280033 | 22 宁波银行二级资本债 01  | 2026 年 7 月 1 日 | 104.76 | 600,000   | 62,856,332.05  |
| 092280069 | 22 华夏银行二级资本债 01  | 2026 年 7 月 1 日 | 104.43 | 500,000   | 52,213,150.68  |
| 092280131 | 22 建行二级资本债 02A   | 2026 年 7 月 1 日 | 103.89 | 227,000   | 23,583,434.25  |
| 250431    | 25 农发 31         | 2026 年 7 月 1 日 | 101.27 | 127,000   | 12,861,175.18  |
| 092280080 | 22 光大银行二级资本债 01A | 2026 年 7 月 2 日 | 104.41 | 895,000   | 93,446,165.34  |
| 合计        |                  |                |        | 2,349,000 | 244,960,257.50 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2026 年 06 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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 10,048,575.34          | -                        |
| 合计     | 10,048,575.34          | -                        |

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 539,118,355.06         | 660,288,752.35           |
| AAA 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 809,076,731.89         | 565,894,488.90           |
| 合计     | 1,348,195,086.95       | 1,226,183,241.25         |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、长期未评级债券为政策性金融债、企业债、中期票据和国债。

#### 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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，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同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<br>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                     | 20,717,454.39  | -              | -              | -              | 20,717,454.39    |
| 结算备付金                    | 4,293,049.69   | -              | -              | -              | 4,293,049.69     |
| 存出保证金                    | 107,580.23     | -              | -              | -              | 107,580.23       |
| 交易性金融资产                  | 191,784,692.04 | 717,782,488.23 | 448,676,482.02 | 266,922,297.70 | 1,625,165,959.99 |
| 买入返售金融资产                 | 30,000,000.00  | -              | -              | -              | 30,000,000.00    |
| 应收申购款                    | -              | -              | -              | 6,412.95       | 6,412.95         |
| 应收清算款                    | -              | -              | -              | 257,491.61     | 257,491.61       |
| 资产总计                     | 246,902,776.35 | 717,782,488.23 | 448,676,482.02 | 267,186,202.26 | 1,680,547,948.86 |
| 负债                       |                |                |                |                |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -              | 3,580,068.80   | 3,580,068.80     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -              | 401,239.33     | 401,239.33       |
| 应付托管费                    | -              | -              | -              | 91,711.84      | 91,711.84        |
| 应付清算款                    | -              | -              | -              | 5,165,106.15   | 5,165,106.15     |
| 卖出回购金融资产款                | 223,125,682.38 | -              | -              | -              | 223,125,682.38   |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -              | 21,787.03      | 21,787.03        |
| 应交税费                     | -              | -              | -              | 58,308.93      | 58,308.93        |
| 其他负债                     | -              | -              | -              | 376,811.35     | 376,811.35       |
| 负债总计                     | 223,125,682.38 | -              | -              | 9,695,033.43   | 232,820,715.81   |
| 利率敏感度缺口                  | 23,777,093.97  | 717,782,488.23 | 448,676,482.02 | 257,491,168.83 | 1,447,727,233.05 |
| 上年度末<br>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                     | 128,893,539.54 | -              | -              | -              | 128,893,539.54   |
| 结算备付金                    | 16,007,365.67  | -              | -              | -              | 16,007,365.67    |

|           |                |                |                |                |                  |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 存出保证金     | 139,991.07     | -              | -              | -              | 139,991.07       |
| 交易性金融资产   | 151,764,972.61 | 506,095,638.90 | 568,322,629.74 | 281,095,860.83 | 1,507,279,102.08 |
| 应收申购款     | -              | -              | -              | 97,951.02      | 97,951.02        |
| 应收清算款     | -              | -              | -              | 7,489,864.46   | 7,489,864.46     |
| 资产总计      | 296,805,868.89 | 506,095,638.90 | 568,322,629.74 | 288,683,676.31 | 1,659,907,813.84 |
| 负债        | -              | -              | -              | -              | -                |
| 应付赎回款     | -              | -              | -              | 86,946,569.79  | 86,946,569.79    |
| 应付管理人报酬   | -              | -              | -              | 528,483.06     | 528,483.06       |
| 应付托管费     | -              | -              | -              | 120,796.14     | 120,796.14       |
| 卖出回购金融资产款 | 50,006,025.10  | -              | -              | -              | 50,006,025.10    |
| 应付销售服务费   | -              | -              | -              | 71,203.90      | 71,203.90        |
| 应交税费      | -              | -              | -              | 33,128.80      | 33,128.80        |
| 其他负债      | -              | -              | -              | 606,457.20     | 606,457.20       |
| 负债总计      | 50,006,025.10  | -              | -              | 88,306,638.89  | 138,312,663.99   |
| 利率敏感度缺口   | 246,799,843.79 | 506,095,638.90 | 568,322,629.74 | 200,377,037.42 | 1,521,595,149.85 |

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                                  | 11,290,973.61               | 11,699,612.35          |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点                                  | -11,136,745.51              | -11,519,419.63         |

#### 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 5%-20%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 266,922,297.70         | 18.44            | 281,095,860.83           | 18.47            |
| 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            | 266,922,297.70         | 18.44            | 281,095,860.83           | 18.47            |

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 18.44%（2025 年 12 月 31 日：18.47%），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。

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：<br><br>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；<br><br>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；<br><br>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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 266,763,135.70         | 280,567,833.83           |
| 第二层次          | 1,358,402,824.29       | 1,226,711,268.25         |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 1,625,165,959.99       | 1,507,279,102.08         |

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              | 266,922,297.70   | 15.88         |
|    | 其中：股票             | 266,922,297.70   | 15.88         |
| 2  | 基金投资              | —                | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,358,243,662.29 | 80.82         |
|    | 其中：债券             | 1,358,243,662.29 | 80.82         |
|    | 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          | 30,000,000.00    | 1.79          |
|    | 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      | 25,010,504.08    | 1.49          |
| 8  | 其他各项资产            | 371,484.79       | 0.02          |
| 9  | 合计                | 1,680,547,948.86 | 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         | 1,269,508.50   | 0.09          |
| B  | 采矿业              | 15,747,911.00  | 1.09          |
| C  | 制造业              | 184,338,155.15 | 12.73         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,911,263.00   | 0.34          |
| E  | 建筑业              | 2,423,053.00   | 0.17          |
| F  | 批发和零售业           | 4,817,777.00   | 0.33          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,784,892.00   | 0.19          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 19,626,832.65  | 1.36          |
| J  | 金融业              | 20,658,753.00  | 1.43          |
| K  | 房地产业             | 1,281,411.00   | 0.09          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,165,232.00   | 0.08          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 4,912,212.00   | 0.34          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 1,504,171.40   | 0.10          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —             |
| P  | 教育               | 487,943.00     | 0.03          |

|   |           |                   |        |
|---|-----------|-------------------|--------|
| Q | 卫生和社会工作   | -                 | -      |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 993, 183. 00      | 0. 07  |
| S | 综合        | -                 | -      |
|   | 合计        | 266, 922, 297. 70 | 18. 44 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股）    | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|----------|------------------|--------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创   | 8, 000   | 10, 160, 000. 00 | 0. 70        |
| 2  | 300750 | 宁德时代   | 19, 440  | 7, 640, 114. 40  | 0. 53        |
| 3  | 300502 | 新易盛    | 10, 520  | 6, 385, 640. 00  | 0. 44        |
| 4  | 600519 | 贵州茅台   | 4, 000   | 4, 741, 960. 00  | 0. 33        |
| 5  | 601318 | 中国平安   | 85, 100  | 4, 062, 674. 00  | 0. 28        |
| 6  | 688256 | 寒武纪    | 2, 541   | 4, 054, 292. 55  | 0. 28        |
| 7  | 600036 | 招商银行   | 99, 700  | 3, 539, 350. 00  | 0. 24        |
| 8  | 601899 | 紫金矿业   | 135, 500 | 3, 406, 470. 00  | 0. 24        |
| 9  | 688008 | 澜起科技   | 10, 405  | 3, 224, 509. 50  | 0. 22        |
| 10 | 002475 | 立讯精密   | 43, 700  | 3, 076, 480. 00  | 0. 21        |
| 11 | 000333 | 美的集团   | 40, 700  | 3, 074, 071. 00  | 0. 21        |
| 12 | 688041 | 海光信息   | 8, 295   | 3, 071, 638. 50  | 0. 21        |
| 13 | 688981 | 中芯国际   | 17, 770  | 2, 822, 231. 40  | 0. 19        |
| 14 | 600900 | 长江电力   | 106, 300 | 2, 813, 761. 00  | 0. 19        |
| 15 | 600030 | 中信证券   | 91, 200  | 2, 620, 176. 00  | 0. 18        |
| 16 | 601166 | 兴业银行   | 145, 400 | 2, 407, 824. 00  | 0. 17        |
| 17 | 300476 | 胜宏科技   | 6, 100   | 2, 113, 223. 00  | 0. 15        |
| 18 | 600487 | 亨通光电   | 18, 900  | 2, 066, 526. 00  | 0. 14        |
| 19 | 603986 | 兆易创新   | 2, 400   | 1, 956, 000. 00  | 0. 14        |
| 20 | 000651 | 格力电器   | 47, 300  | 1, 773, 750. 00  | 0. 12        |
| 21 | 002371 | 北方华创   | 1, 900   | 1, 680, 664. 00  | 0. 12        |
| 22 | 601288 | 农业银行   | 273, 400 | 1, 659, 538. 00  | 0. 11        |
| 23 | 688498 | 源杰科技   | 876      | 1, 652, 136. 00  | 0. 11        |
| 24 | 000338 | 潍柴动力   | 60, 100  | 1, 637, 725. 00  | 0. 11        |
| 25 | 603259 | 药明康德   | 13, 000  | 1, 618, 630. 00  | 0. 11        |
| 26 | 000858 | 五 粮 液  | 21, 700  | 1, 605, 800. 00  | 0. 11        |
| 27 | 000100 | TCL 科技 | 275, 200 | 1, 601, 664. 00  | 0. 11        |
| 28 | 002384 | 东山精密   | 6, 000   | 1, 574, 100. 00  | 0. 11        |
| 29 | 002415 | 海康威视   | 44, 200  | 1, 511, 640. 00  | 0. 10        |
| 30 | 603993 | 洛阳钼业   | 86, 100  | 1, 511, 055. 00  | 0. 10        |
| 31 | 300124 | 汇川技术   | 22, 000  | 1, 459, 260. 00  | 0. 10        |
| 32 | 300857 | 协创数据   | 4, 200   | 1, 427, 580. 00  | 0. 10        |

|    |        |       |         |              |      |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 33 | 000063 | 中兴通讯  | 38,700  | 1,400,553.00 | 0.10 |
| 34 | 601857 | 中国石油  | 158,500 | 1,375,780.00 | 0.10 |
| 35 | 601088 | 中国神华  | 35,100  | 1,370,304.00 | 0.09 |
| 36 | 600309 | 万华化学  | 19,700  | 1,347,677.00 | 0.09 |
| 37 | 600549 | 厦门钨业  | 15,200  | 1,295,040.00 | 0.09 |
| 38 | 601601 | 中国太保  | 44,300  | 1,263,436.00 | 0.09 |
| 39 | 600150 | 中国船舶  | 37,100  | 1,253,609.00 | 0.09 |
| 40 | 600406 | 国电南瑞  | 54,700  | 1,249,895.00 | 0.09 |
| 41 | 002602 | 世纪华通  | 86,300  | 1,216,830.00 | 0.08 |
| 42 | 603501 | 豪威集团  | 12,800  | 1,214,080.00 | 0.08 |
| 43 | 000657 | 中钨高新  | 12,600  | 1,206,072.00 | 0.08 |
| 44 | 300760 | 迈瑞医疗  | 8,700   | 1,181,721.00 | 0.08 |
| 45 | 000977 | 浪潮信息  | 16,600  | 1,162,000.00 | 0.08 |
| 46 | 601728 | 中国电信  | 223,700 | 1,161,003.00 | 0.08 |
| 47 | 000725 | 京东方 A | 131,100 | 1,137,948.00 | 0.08 |
| 48 | 603799 | 华友钴业  | 23,500  | 1,134,110.00 | 0.08 |
| 49 | 002352 | 顺丰控股  | 36,100  | 1,128,486.00 | 0.08 |
| 50 | 002049 | 紫光国微  | 12,600  | 1,118,250.00 | 0.08 |
| 51 | 002851 | 麦格米特  | 6,500   | 1,086,670.00 | 0.08 |
| 52 | 688432 | 有研硅   | 27,106  | 1,083,426.82 | 0.07 |
| 53 | 300274 | 阳光电源  | 6,800   | 1,081,336.00 | 0.07 |
| 54 | 600938 | 中国海油  | 39,500  | 1,072,425.00 | 0.07 |
| 55 | 600919 | 江苏银行  | 99,300  | 1,070,454.00 | 0.07 |
| 56 | 600031 | 三一重工  | 61,800  | 1,067,904.00 | 0.07 |
| 57 | 000425 | 徐工机械  | 132,000 | 1,067,880.00 | 0.07 |
| 58 | 300059 | 东方财富  | 52,200  | 1,063,836.00 | 0.07 |
| 59 | 601600 | 中国铝业  | 127,800 | 1,050,516.00 | 0.07 |
| 60 | 601766 | 中国中车  | 201,200 | 1,046,240.00 | 0.07 |
| 61 | 002080 | 中材科技  | 11,600  | 1,044,000.00 | 0.07 |
| 62 | 688012 | 中微公司  | 2,179   | 1,020,861.50 | 0.07 |
| 63 | 002625 | 光启技术  | 33,600  | 1,018,752.00 | 0.07 |
| 64 | 600893 | 航发动力  | 26,100  | 1,000,674.00 | 0.07 |
| 65 | 002738 | 中矿资源  | 16,800  | 991,032.00   | 0.07 |
| 66 | 688525 | 佰维存储  | 1,997   | 987,975.81   | 0.07 |
| 67 | 002027 | 分众传媒  | 202,700 | 981,068.00   | 0.07 |
| 68 | 600489 | 中金黄金  | 54,300  | 980,115.00   | 0.07 |
| 69 | 601658 | 邮储银行  | 194,800 | 960,364.00   | 0.07 |
| 70 | 000426 | 兴业银锡  | 29,000  | 955,840.00   | 0.07 |
| 71 | 601127 | 赛力斯   | 15,600  | 955,500.00   | 0.07 |
| 72 | 600482 | 中国动力  | 29,000  | 951,200.00   | 0.07 |
| 73 | 600104 | 上汽集团  | 96,900  | 945,744.00   | 0.07 |
| 74 | 688099 | 晶晨股份  | 9,187   | 945,342.30   | 0.07 |
| 75 | 688111 | 金山办公  | 4,375   | 932,093.75   | 0.06 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 76  | 600989 | 宝丰能源 | 45,700  | 929,081.00 | 0.06 |
| 77  | 300418 | 昆仑万维 | 22,700  | 916,172.00 | 0.06 |
| 78  | 605499 | 东鹏饮料 | 7,400   | 913,382.00 | 0.06 |
| 79  | 300450 | 先导智能 | 22,400  | 912,128.00 | 0.06 |
| 80  | 600585 | 海螺水泥 | 53,500  | 906,825.00 | 0.06 |
| 81  | 600418 | 江淮汽车 | 35,000  | 904,050.00 | 0.06 |
| 82  | 600066 | 宇通客车 | 33,700  | 903,497.00 | 0.06 |
| 83  | 600875 | 东方电气 | 31,400  | 903,378.00 | 0.06 |
| 84  | 600547 | 山东黄金 | 38,400  | 886,656.00 | 0.06 |
| 85  | 600050 | 中国联通 | 218,000 | 872,000.00 | 0.06 |
| 86  | 000408 | 藏格矿业 | 12,500  | 866,500.00 | 0.06 |
| 87  | 600276 | 恒瑞医药 | 16,600  | 863,864.00 | 0.06 |
| 88  | 601868 | 中国能建 | 322,200 | 860,274.00 | 0.06 |
| 89  | 000988 | 华工科技 | 4,600   | 849,206.00 | 0.06 |
| 90  | 002195 | 岩山科技 | 128,200 | 838,428.00 | 0.06 |
| 91  | 000938 | 紫光股份 | 28,700  | 828,282.00 | 0.06 |
| 92  | 600233 | 圆通速递 | 52,400  | 825,300.00 | 0.06 |
| 93  | 003816 | 中国广核 | 211,000 | 825,010.00 | 0.06 |
| 94  | 000034 | 神州数码 | 29,600  | 821,400.00 | 0.06 |
| 95  | 600941 | 中国移动 | 9,500   | 818,235.00 | 0.06 |
| 96  | 601168 | 西部矿业 | 29,900  | 811,486.00 | 0.06 |
| 97  | 605117 | 德业股份 | 7,560   | 802,720.80 | 0.06 |
| 98  | 300408 | 三环集团 | 4,800   | 801,120.00 | 0.06 |
| 99  | 601877 | 正泰电器 | 31,900  | 799,733.00 | 0.06 |
| 100 | 002241 | 歌尔股份 | 34,400  | 775,032.00 | 0.05 |
| 101 | 600426 | 华鲁恒升 | 32,400  | 775,008.00 | 0.05 |
| 102 | 001979 | 招商蛇口 | 120,500 | 774,815.00 | 0.05 |
| 103 | 688223 | 晶科能源 | 161,228 | 765,833.00 | 0.05 |
| 104 | 301550 | 斯菱智驱 | 8,342   | 762,709.06 | 0.05 |
| 105 | 000157 | 中联重科 | 108,700 | 757,639.00 | 0.05 |
| 106 | 000967 | 盈峰环境 | 71,800  | 756,054.00 | 0.05 |
| 107 | 300475 | 香农芯创 | 2,500   | 750,000.00 | 0.05 |
| 108 | 601633 | 长城汽车 | 49,500  | 746,955.00 | 0.05 |
| 109 | 600111 | 北方稀土 | 15,300  | 735,165.00 | 0.05 |
| 110 | 688090 | 瑞松科技 | 6,890   | 733,440.50 | 0.05 |
| 111 | 688183 | 生益电子 | 5,373   | 711,385.20 | 0.05 |
| 112 | 000617 | 中油资本 | 107,200 | 706,448.00 | 0.05 |
| 113 | 603179 | 新泉股份 | 14,200  | 705,030.00 | 0.05 |
| 114 | 000975 | 山金国际 | 41,200  | 700,400.00 | 0.05 |
| 115 | 300223 | 北京君正 | 2,800   | 696,920.00 | 0.05 |
| 116 | 601211 | 国泰海通 | 38,200  | 695,240.00 | 0.05 |
| 117 | 002294 | 信立泰  | 21,600  | 688,824.00 | 0.05 |
| 118 | 600601 | 方正科技 | 49,500  | 685,080.00 | 0.05 |



|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 119 | 688107 | 安路科技 | 14,977 | 682,951.20 | 0.05 |
| 120 | 688677 | 海泰新光 | 6,749  | 682,526.37 | 0.05 |
| 121 | 601231 | 环旭电子 | 21,000 | 680,400.00 | 0.05 |
| 122 | 601208 | 东材科技 | 9,600  | 679,584.00 | 0.05 |
| 123 | 603893 | 瑞芯微  | 3,600  | 678,096.00 | 0.05 |
| 124 | 688733 | 壹石通  | 16,398 | 678,057.30 | 0.05 |
| 125 | 688195 | 腾景科技 | 3,509  | 675,763.22 | 0.05 |
| 126 | 601138 | 工业富联 | 9,200  | 663,780.00 | 0.05 |
| 127 | 688568 | 中科星图 | 15,980 | 662,690.60 | 0.05 |
| 128 | 603083 | 剑桥科技 | 2,600  | 662,662.00 | 0.05 |
| 129 | 688766 | 普冉股份 | 860    | 659,276.00 | 0.05 |
| 130 | 002463 | 沪电股份 | 4,300  | 657,040.00 | 0.05 |
| 131 | 688775 | 影石创新 | 4,732  | 656,091.80 | 0.05 |
| 132 | 600498 | 烽火通信 | 8,904  | 655,334.40 | 0.05 |
| 133 | 600536 | 中国软件 | 23,300 | 655,196.00 | 0.05 |
| 134 | 601869 | 长飞光纤 | 1,200  | 655,080.00 | 0.05 |
| 135 | 603738 | 泰晶科技 | 10,900 | 654,545.00 | 0.05 |
| 136 | 688257 | 新锐股份 | 6,400  | 652,160.00 | 0.05 |
| 137 | 301200 | 大族数控 | 1,800  | 649,170.00 | 0.04 |
| 138 | 300672 | 国科微  | 2,200  | 649,000.00 | 0.04 |
| 139 | 300394 | 天孚通信 | 2,140  | 647,735.20 | 0.04 |
| 140 | 001203 | 大中矿业 | 21,600 | 646,920.00 | 0.04 |
| 141 | 605056 | 咸亨国际 | 40,300 | 644,800.00 | 0.04 |
| 142 | 600629 | 华建集团 | 53,200 | 644,252.00 | 0.04 |
| 143 | 688300 | 联瑞新材 | 2,635  | 643,994.00 | 0.04 |
| 144 | 000534 | 万泽股份 | 23,500 | 642,960.00 | 0.04 |
| 145 | 600879 | 航天电子 | 30,200 | 642,958.00 | 0.04 |
| 146 | 002273 | 水晶光电 | 17,900 | 635,092.00 | 0.04 |
| 147 | 000893 | 亚钾国际 | 15,500 | 633,795.00 | 0.04 |
| 148 | 600183 | 生益科技 | 3,600  | 624,240.00 | 0.04 |
| 149 | 688523 | 航天环宇 | 11,879 | 622,459.60 | 0.04 |
| 150 | 688515 | 裕太微  | 2,500  | 621,900.00 | 0.04 |
| 151 | 688625 | 呈和科技 | 7,352  | 620,582.32 | 0.04 |
| 152 | 601898 | 中煤能源 | 50,200 | 611,436.00 | 0.04 |
| 153 | 600660 | 福耀玻璃 | 12,000 | 605,280.00 | 0.04 |
| 154 | 688668 | 鼎通科技 | 1,598  | 596,533.40 | 0.04 |
| 155 | 300255 | 常山药业 | 24,500 | 573,790.00 | 0.04 |
| 156 | 605196 | 华通线缆 | 21,800 | 568,980.00 | 0.04 |
| 157 | 603920 | 世运电路 | 11,800 | 566,872.00 | 0.04 |
| 158 | 600299 | 安迪苏  | 70,300 | 551,855.00 | 0.04 |
| 159 | 600809 | 山西汾酒 | 5,000  | 546,850.00 | 0.04 |
| 160 | 600188 | 兖矿能源 | 30,700 | 545,539.00 | 0.04 |
| 161 | 688433 | 华曙高科 | 6,270  | 536,712.00 | 0.04 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 162 | 002460 | 赣锋锂业  | 7,800   | 510,120.00 | 0.04 |
| 163 | 000807 | 云铝股份  | 22,700  | 502,578.00 | 0.03 |
| 164 | 601328 | 交通银行  | 77,500  | 498,325.00 | 0.03 |
| 165 | 002028 | 思源电气  | 2,700   | 467,100.00 | 0.03 |
| 166 | 300290 | ST 荣科 | 68,700  | 456,855.00 | 0.03 |
| 167 | 601698 | 中国卫通  | 14,400  | 435,600.00 | 0.03 |
| 168 | 300661 | 圣邦股份  | 3,000   | 430,440.00 | 0.03 |
| 169 | 002532 | 天山铝业  | 40,000  | 429,200.00 | 0.03 |
| 170 | 000060 | 中金岭南  | 55,600  | 420,892.00 | 0.03 |
| 171 | 600025 | 华能水电  | 47,000  | 417,830.00 | 0.03 |
| 172 | 601225 | 陕西煤业  | 18,900  | 384,615.00 | 0.03 |
| 173 | 002001 | 新 和 成 | 13,300  | 377,986.00 | 0.03 |
| 174 | 002484 | 江海股份  | 3,500   | 367,500.00 | 0.03 |
| 175 | 688372 | 伟测科技  | 1,917   | 356,562.00 | 0.02 |
| 176 | 688355 | 明志科技  | 17,827  | 343,169.75 | 0.02 |
| 177 | 600887 | 伊利股份  | 14,300  | 342,628.00 | 0.02 |
| 178 | 301511 | 德福科技  | 2,300   | 330,855.00 | 0.02 |
| 179 | 688205 | 德科立   | 1,542   | 321,028.98 | 0.02 |
| 180 | 000039 | 中集集团  | 39,400  | 319,534.00 | 0.02 |
| 181 | 603019 | 中科曙光  | 2,900   | 310,967.00 | 0.02 |
| 182 | 688517 | 金冠电气  | 17,700  | 309,396.00 | 0.02 |
| 183 | 002857 | 三晖电气  | 17,400  | 305,718.00 | 0.02 |
| 184 | 300778 | 新城市   | 32,000  | 305,600.00 | 0.02 |
| 185 | 300635 | 中达安   | 25,100  | 305,467.00 | 0.02 |
| 186 | 605177 | 东亚药业  | 17,800  | 304,558.00 | 0.02 |
| 187 | 301336 | 趣睡科技  | 7,600   | 303,620.00 | 0.02 |
| 188 | 300838 | 浙江力诺  | 22,700  | 303,045.00 | 0.02 |
| 189 | 002487 | 大金重工  | 5,200   | 301,444.00 | 0.02 |
| 190 | 300923 | 研奥股份  | 13,400  | 298,552.00 | 0.02 |
| 191 | 603177 | 德创环保  | 36,000  | 297,720.00 | 0.02 |
| 192 | 600493 | 凤竹纺织  | 56,800  | 297,632.00 | 0.02 |
| 193 | 002760 | 凤形股份  | 17,900  | 293,918.00 | 0.02 |
| 194 | 601816 | 京沪高铁  | 64,800  | 293,544.00 | 0.02 |
| 195 | 301198 | 喜悦智行  | 21,900  | 293,460.00 | 0.02 |
| 196 | 603331 | 百达精工  | 27,500  | 293,150.00 | 0.02 |
| 197 | 300517 | 海波重科  | 31,100  | 292,962.00 | 0.02 |
| 198 | 001373 | 翔腾新材  | 9,700   | 292,455.00 | 0.02 |
| 199 | 002652 | 扬子新材  | 68,600  | 292,236.00 | 0.02 |
| 200 | 688659 | 元琛科技  | 27,952  | 291,818.88 | 0.02 |
| 201 | 300844 | 山水比德  | 13,100  | 290,951.00 | 0.02 |
| 202 | 688092 | 爱科科技  | 13,688  | 290,733.12 | 0.02 |
| 203 | 600807 | 济高发展  | 124,100 | 290,394.00 | 0.02 |
| 204 | 300605 | 恒锋信息  | 31,400  | 290,136.00 | 0.02 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 205 | 688681 | 科汇股份 | 20,751  | 290,098.98 | 0.02 |
| 206 | 688132 | 邦彦技术 | 22,031  | 289,707.65 | 0.02 |
| 207 | 301098 | 金埔园林 | 35,300  | 289,460.00 | 0.02 |
| 208 | 002858 | 力盛体育 | 26,500  | 289,115.00 | 0.02 |
| 209 | 300176 | 鸿特科技 | 59,500  | 288,575.00 | 0.02 |
| 210 | 300254 | 仟源医药 | 36,000  | 288,360.00 | 0.02 |
| 211 | 300417 | 南华仪器 | 28,100  | 288,306.00 | 0.02 |
| 212 | 688038 | 中科通达 | 17,122  | 287,992.04 | 0.02 |
| 213 | 001278 | 一彬科技 | 18,700  | 287,606.00 | 0.02 |
| 214 | 002329 | 皇氏集团 | 107,700 | 287,559.00 | 0.02 |
| 215 | 301515 | 港通医疗 | 16,400  | 287,492.00 | 0.02 |
| 216 | 300703 | 创源股份 | 22,500  | 287,325.00 | 0.02 |
| 217 | 002629 | 仁智股份 | 66,800  | 287,240.00 | 0.02 |
| 218 | 300305 | 裕兴股份 | 49,000  | 287,140.00 | 0.02 |
| 219 | 600992 | 贵绳股份 | 33,300  | 287,046.00 | 0.02 |
| 220 | 600149 | 廊坊发展 | 63,900  | 286,911.00 | 0.02 |
| 221 | 688597 | 煜邦电力 | 44,134  | 286,871.00 | 0.02 |
| 222 | 003042 | 中农联合 | 23,600  | 286,740.00 | 0.02 |
| 223 | 300876 | 蒙泰高新 | 20,000  | 286,600.00 | 0.02 |
| 224 | 300886 | 华业香料 | 14,400  | 286,560.00 | 0.02 |
| 225 | 600778 | 友好集团 | 58,600  | 286,554.00 | 0.02 |
| 226 | 300614 | 百川畅银 | 29,600  | 286,528.00 | 0.02 |
| 227 | 300535 | 达威股份 | 21,000  | 286,230.00 | 0.02 |
| 228 | 003001 | 中岩大地 | 22,100  | 286,195.00 | 0.02 |
| 229 | 600802 | 福建水泥 | 69,400  | 285,928.00 | 0.02 |
| 230 | 000702 | 正虹科技 | 57,600  | 285,696.00 | 0.02 |
| 231 | 600455 | 博通股份 | 13,000  | 285,480.00 | 0.02 |
| 232 | 300106 | 西部牧业 | 29,000  | 285,360.00 | 0.02 |
| 233 | 688528 | 秦川物联 | 31,216  | 285,314.24 | 0.02 |
| 234 | 688613 | 奥精医疗 | 20,200  | 285,022.00 | 0.02 |
| 235 | 300405 | 科隆股份 | 55,000  | 284,900.00 | 0.02 |
| 236 | 688638 | 誉辰智能 | 9,139   | 284,862.63 | 0.02 |
| 237 | 300851 | 交大思诺 | 12,800  | 284,800.00 | 0.02 |
| 238 | 688565 | 力源科技 | 30,131  | 284,737.95 | 0.02 |
| 239 | 000856 | 冀东装备 | 39,800  | 284,570.00 | 0.02 |
| 240 | 688067 | 爱威科技 | 14,107  | 284,256.05 | 0.02 |
| 241 | 301231 | 荣信文化 | 11,200  | 284,032.00 | 0.02 |
| 242 | 688288 | 鸿泉技术 | 15,977  | 283,911.29 | 0.02 |
| 243 | 688004 | 博汇科技 | 15,581  | 283,574.20 | 0.02 |
| 244 | 002778 | 中晟高科 | 18,600  | 282,720.00 | 0.02 |
| 245 | 301167 | 建研设计 | 22,800  | 282,492.00 | 0.02 |
| 246 | 603208 | 江山欧派 | 26,400  | 282,480.00 | 0.02 |
| 247 | 688203 | 海正生材 | 28,300  | 282,434.00 | 0.02 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 248 | 301298 | 东利机械 | 24,400  | 282,308.00 | 0.02 |
| 249 | 600697 | 欧亚集团 | 29,000  | 281,880.00 | 0.02 |
| 250 | 300615 | 欣天科技 | 28,100  | 281,843.00 | 0.02 |
| 251 | 002696 | 百洋股份 | 56,700  | 281,799.00 | 0.02 |
| 252 | 603968 | 醋化股份 | 30,400  | 281,504.00 | 0.02 |
| 253 | 603022 | 新通联  | 35,200  | 281,248.00 | 0.02 |
| 254 | 002809 | 红墙股份 | 37,800  | 281,232.00 | 0.02 |
| 255 | 600561 | 江西长运 | 56,700  | 280,665.00 | 0.02 |
| 256 | 002513 | 蓝丰生化 | 58,700  | 280,586.00 | 0.02 |
| 257 | 600448 | 华纺股份 | 111,100 | 279,972.00 | 0.02 |
| 258 | 003023 | 彩虹集团 | 14,400  | 279,936.00 | 0.02 |
| 259 | 300556 | 丝路视觉 | 16,100  | 279,657.00 | 0.02 |
| 260 | 688466 | 金科环境 | 21,780  | 279,437.40 | 0.02 |
| 261 | 600137 | 浪莎股份 | 17,200  | 279,156.00 | 0.02 |
| 262 | 002679 | 福建金森 | 35,400  | 278,952.00 | 0.02 |
| 263 | 002820 | 桂发祥  | 33,200  | 278,880.00 | 0.02 |
| 264 | 002105 | 信隆健康 | 56,400  | 278,616.00 | 0.02 |
| 265 | 001366 | 播恩集团 | 25,700  | 278,588.00 | 0.02 |
| 266 | 002205 | 国统股份 | 27,500  | 277,475.00 | 0.02 |
| 267 | 600689 | 上海三毛 | 28,600  | 277,420.00 | 0.02 |
| 268 | 688078 | 龙软科技 | 13,171  | 277,249.55 | 0.02 |
| 269 | 688393 | 安必平  | 15,587  | 277,136.86 | 0.02 |
| 270 | 603168 | 莎普爱思 | 58,700  | 277,064.00 | 0.02 |
| 271 | 000953 | 中哲精化 | 53,600  | 276,576.00 | 0.02 |
| 272 | 605567 | 春雪食品 | 34,600  | 276,454.00 | 0.02 |
| 273 | 600257 | 大湖股份 | 63,700  | 275,821.00 | 0.02 |
| 274 | 002133 | 广宇集团 | 115,400 | 275,806.00 | 0.02 |
| 275 | 603860 | 中公高科 | 11,400  | 275,766.00 | 0.02 |
| 276 | 000663 | 永安林业 | 54,000  | 275,400.00 | 0.02 |
| 277 | 002873 | 新天药业 | 37,600  | 275,232.00 | 0.02 |
| 278 | 603908 | 牧高笛  | 16,300  | 275,144.00 | 0.02 |
| 279 | 300126 | 锐奇股份 | 47,600  | 275,128.00 | 0.02 |
| 280 | 003011 | 海象新材 | 15,100  | 274,367.00 | 0.02 |
| 281 | 002144 | 宏达高科 | 27,700  | 272,845.00 | 0.02 |
| 282 | 603151 | 邦基科技 | 24,800  | 272,552.00 | 0.02 |
| 283 | 600159 | 大龙地产 | 123,300 | 272,493.00 | 0.02 |
| 284 | 603214 | 爱婴室  | 22,500  | 272,475.00 | 0.02 |
| 285 | 600099 | 林海股份 | 34,100  | 272,118.00 | 0.02 |
| 286 | 002671 | 龙泉股份 | 73,300  | 271,943.00 | 0.02 |
| 287 | 301113 | 雅艺科技 | 18,200  | 271,362.00 | 0.02 |
| 288 | 002817 | 黄山胶囊 | 46,300  | 271,318.00 | 0.02 |
| 289 | 300335 | 迪森股份 | 55,700  | 271,259.00 | 0.02 |
| 290 | 688329 | 艾隆科技 | 13,419  | 271,197.99 | 0.02 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 291 | 300892 | 品渥食品 | 14,400 | 270,432.00 | 0.02 |
| 292 | 603029 | 天鹅股份 | 19,200 | 269,952.00 | 0.02 |
| 293 | 603073 | 彩蝶实业 | 18,100 | 269,871.00 | 0.02 |
| 294 | 000995 | 皇台酒业 | 28,400 | 269,800.00 | 0.02 |
| 295 | 000633 | 合金投资 | 56,600 | 269,416.00 | 0.02 |
| 296 | 603768 | 常青股份 | 29,400 | 268,422.00 | 0.02 |
| 297 | 603810 | 丰山集团 | 24,100 | 268,233.00 | 0.02 |
| 298 | 600706 | 曲江文旅 | 39,800 | 267,854.00 | 0.02 |
| 299 | 002732 | 燕塘乳业 | 21,600 | 267,840.00 | 0.02 |
| 300 | 603536 | 惠发食品 | 34,300 | 267,197.00 | 0.02 |
| 301 | 002909 | 集泰股份 | 53,800 | 265,772.00 | 0.02 |
| 302 | 002343 | 慈文传媒 | 60,900 | 265,524.00 | 0.02 |
| 303 | 301505 | 苏州规划 | 16,400 | 264,040.00 | 0.02 |
| 304 | 300549 | 优德精密 | 20,100 | 261,702.00 | 0.02 |
| 305 | 688426 | 康为世纪 | 14,030 | 257,310.20 | 0.02 |
| 306 | 688051 | 佳华科技 | 10,733 | 246,644.34 | 0.02 |
| 307 | 600883 | 博闻科技 | 34,000 | 238,000.00 | 0.02 |
| 308 | 301010 | 晶雪节能 | 14,500 | 236,205.00 | 0.02 |
| 309 | 301163 | 宏德股份 | 10,600 | 235,108.00 | 0.02 |
| 310 | 603079 | 圣达生物 | 20,700 | 234,324.00 | 0.02 |
| 311 | 688089 | 嘉必优  | 22,051 | 233,961.11 | 0.02 |
| 312 | 688013 | 天臣医疗 | 9,483  | 233,945.61 | 0.02 |
| 313 | 600235 | 民丰特纸 | 47,000 | 233,590.00 | 0.02 |
| 314 | 301006 | 迈拓股份 | 18,500 | 232,175.00 | 0.02 |
| 315 | 002188 | 中天服务 | 47,100 | 230,790.00 | 0.02 |
| 316 | 002836 | 新宏泽  | 24,900 | 230,076.00 | 0.02 |
| 317 | 300707 | 威唐工业 | 20,400 | 228,072.00 | 0.02 |
| 318 | 603385 | 惠达卫浴 | 46,400 | 226,432.00 | 0.02 |
| 319 | 600097 | 开创国际 | 29,100 | 226,398.00 | 0.02 |
| 320 | 300645 | 正元智慧 | 19,100 | 224,807.00 | 0.02 |
| 321 | 000705 | 浙江震元 | 38,400 | 224,640.00 | 0.02 |
| 322 | 002230 | 科大讯飞 | 5,500  | 224,620.00 | 0.02 |
| 323 | 603228 | 景旺电子 | 3,100  | 224,471.00 | 0.02 |
| 324 | 301037 | 保立佳  | 18,700 | 224,400.00 | 0.02 |
| 325 | 603180 | 金牌家居 | 16,300 | 223,636.00 | 0.02 |
| 326 | 002999 | 天禾股份 | 42,000 | 223,440.00 | 0.02 |
| 327 | 000985 | 大庆华科 | 15,700 | 223,411.00 | 0.02 |
| 328 | 300642 | 透景生命 | 18,800 | 221,840.00 | 0.02 |
| 329 | 001260 | 坤泰股份 | 14,100 | 220,665.00 | 0.02 |
| 330 | 300675 | 建科院  | 18,500 | 219,225.00 | 0.02 |
| 331 | 300958 | 建工修复 | 20,500 | 218,120.00 | 0.02 |
| 332 | 688021 | 奥福科技 | 11,257 | 217,935.52 | 0.02 |
| 333 | 002591 | 恒大高新 | 35,100 | 214,812.00 | 0.01 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 334 | 603982 | 泉峰汽车 | 38,400 | 214,656.00 | 0.01 |
| 335 | 002799 | 环球印务 | 35,200 | 212,960.00 | 0.01 |
| 336 | 600371 | 万向德农 | 34,070 | 212,937.50 | 0.01 |
| 337 | 300514 | 友讯达  | 22,400 | 209,440.00 | 0.01 |
| 338 | 301065 | 本立科技 | 11,700 | 206,505.00 | 0.01 |
| 339 | 600444 | 国机通用 | 15,900 | 206,382.00 | 0.01 |
| 340 | 600661 | 昂立教育 | 29,300 | 202,463.00 | 0.01 |
| 341 | 001337 | 四川黄金 | 5,500  | 201,630.00 | 0.01 |
| 342 | 300030 | 阳普医疗 | 34,200 | 198,702.00 | 0.01 |
| 343 | 002566 | 益盛药业 | 32,800 | 198,112.00 | 0.01 |
| 344 | 000062 | 深圳华强 | 6,200  | 197,284.00 | 0.01 |
| 345 | 688521 | 芯原股份 | 531    | 197,075.34 | 0.01 |
| 346 | 003008 | 开普检测 | 11,500 | 196,305.00 | 0.01 |
| 347 | 001231 | 农心科技 | 10,600 | 193,344.00 | 0.01 |
| 348 | 600051 | 宁波联合 | 34,300 | 193,109.00 | 0.01 |
| 349 | 301126 | 达嘉维康 | 22,300 | 190,665.00 | 0.01 |
| 350 | 300519 | 新光药业 | 15,600 | 184,860.00 | 0.01 |
| 351 | 600128 | 苏豪弘业 | 24,200 | 183,678.00 | 0.01 |
| 352 | 600774 | 汉商集团 | 28,400 | 177,784.00 | 0.01 |
| 353 | 301359 | 东南电子 | 11,000 | 174,680.00 | 0.01 |
| 354 | 301041 | 金百泽  | 5,000  | 168,750.00 | 0.01 |
| 355 | 688435 | 英方软件 | 5,200  | 166,400.00 | 0.01 |
| 356 | 603709 | 中源家居 | 12,100 | 163,834.00 | 0.01 |
| 357 | 300279 | 和晶科技 | 27,000 | 163,350.00 | 0.01 |
| 358 | 301270 | 汉仪股份 | 6,300  | 161,784.00 | 0.01 |
| 359 | 603076 | 乐惠国际 | 7,800  | 161,616.00 | 0.01 |
| 360 | 603137 | 恒尚节能 | 12,300 | 159,162.00 | 0.01 |
| 361 | 300651 | 金陵体育 | 8,900  | 158,865.00 | 0.01 |
| 362 | 300565 | 科信技术 | 15,600 | 158,808.00 | 0.01 |
| 363 | 601798 | 蓝科高新 | 21,900 | 158,556.00 | 0.01 |
| 364 | 000586 | 汇源通信 | 12,000 | 158,520.00 | 0.01 |
| 365 | 301040 | 中环海陆 | 6,500  | 158,405.00 | 0.01 |
| 366 | 300275 | 梅安森  | 19,700 | 158,191.00 | 0.01 |
| 367 | 600408 | 安泰集团 | 66,400 | 158,032.00 | 0.01 |
| 368 | 300753 | 爱朋医疗 | 8,300  | 157,119.00 | 0.01 |
| 369 | 300930 | 屹通新材 | 5,500  | 156,750.00 | 0.01 |
| 370 | 300637 | 扬帆新材 | 15,100 | 156,738.00 | 0.01 |
| 371 | 688316 | 青云科技 | 2,900  | 156,600.00 | 0.01 |
| 372 | 300804 | 广康生化 | 5,000  | 156,300.00 | 0.01 |
| 373 | 001219 | 青岛食品 | 13,600 | 155,856.00 | 0.01 |
| 374 | 300982 | 苏文电能 | 10,300 | 155,633.00 | 0.01 |
| 375 | 301428 | 世纪恒通 | 4,500  | 155,565.00 | 0.01 |
| 376 | 300157 | 新锦动力 | 42,100 | 155,349.00 | 0.01 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 377 | 000802 | 北京文化 | 44,400 | 154,512.00 | 0.01 |
| 377 | 000978 | 桂林旅游 | 29,600 | 154,512.00 | 0.01 |
| 378 | 002769 | 普路通  | 23,600 | 154,108.00 | 0.01 |
| 379 | 301057 | 汇隆新材 | 6,700  | 154,100.00 | 0.01 |
| 380 | 301526 | 国际复材 | 3,300  | 154,011.00 | 0.01 |
| 381 | 600969 | 郴电国际 | 20,100 | 153,363.00 | 0.01 |
| 382 | 002278 | 神开股份 | 20,300 | 153,062.00 | 0.01 |
| 383 | 600089 | 特变电工 | 6,800  | 153,000.00 | 0.01 |
| 384 | 600721 | 百花医药 | 23,100 | 152,922.00 | 0.01 |
| 385 | 001211 | 双枪科技 | 6,400  | 152,576.00 | 0.01 |
| 386 | 600844 | 金煤科技 | 62,700 | 151,734.00 | 0.01 |
| 387 | 688030 | 山石网科 | 9,562  | 150,983.98 | 0.01 |
| 388 | 002008 | 大族激光 | 1,000  | 150,110.00 | 0.01 |
| 389 | 688310 | 迈得医疗 | 9,765  | 150,088.05 | 0.01 |
| 390 | 000635 | 英力特  | 24,700 | 149,188.00 | 0.01 |
| 391 | 300875 | 捷强装备 | 5,200  | 148,564.00 | 0.01 |
| 392 | 605500 | 森林包装 | 24,000 | 148,320.00 | 0.01 |
| 393 | 300132 | 青松股份 | 25,800 | 146,544.00 | 0.01 |
| 394 | 688317 | 之江生物 | 9,591  | 145,783.20 | 0.01 |
| 395 | 002576 | 通达动力 | 10,200 | 144,330.00 | 0.01 |
| 396 | 605169 | 洪通燃气 | 16,100 | 143,129.00 | 0.01 |
| 397 | 000548 | 湖南投资 | 34,300 | 140,287.00 | 0.01 |
| 398 | 002916 | 深南电路 | 300    | 137,370.00 | 0.01 |
| 399 | 002725 | 跃岭股份 | 11,100 | 136,752.00 | 0.01 |
| 400 | 300956 | 英力股份 | 11,900 | 133,756.00 | 0.01 |
| 401 | 603659 | 璞泰来  | 4,600  | 133,078.00 | 0.01 |
| 402 | 603633 | 徕木股份 | 19,400 | 132,114.00 | 0.01 |
| 403 | 688390 | 固德威  | 1,209  | 131,188.59 | 0.01 |
| 404 | 002771 | 真视通  | 10,400 | 127,712.00 | 0.01 |
| 405 | 600241 | 时代万恒 | 18,300 | 118,767.00 | 0.01 |
| 406 | 688456 | 有研粉材 | 843    | 117,682.80 | 0.01 |
| 407 | 600026 | 中远海能 | 6,500  | 116,610.00 | 0.01 |
| 408 | 300051 | 璿升科技 | 13,300 | 116,508.00 | 0.01 |
| 409 | 300281 | 金明精机 | 19,000 | 114,570.00 | 0.01 |
| 410 | 600176 | 中国巨石 | 1,500  | 109,320.00 | 0.01 |
| 411 | 600522 | 中天科技 | 1,800  | 109,224.00 | 0.01 |
| 412 | 688778 | 厦钨新能 | 1,971  | 107,222.40 | 0.01 |
| 413 | 605180 | 华生科技 | 8,700  | 103,095.00 | 0.01 |
| 414 | 000731 | 四川美丰 | 19,600 | 100,156.00 | 0.01 |
| 415 | 300218 | 安利股份 | 8,300  | 98,770.00  | 0.01 |
| 416 | 002142 | 宁波银行 | 3,200  | 95,008.00  | 0.01 |
| 417 | 000559 | 万向钱潮 | 6,700  | 86,631.00  | 0.01 |
| 418 | 601611 | 中国核建 | 7,600  | 84,740.00  | 0.01 |

|     |        |        |        |           |      |
|-----|--------|--------|--------|-----------|------|
| 419 | 601126 | 四方股份   | 1,300  | 82,160.00 | 0.01 |
| 420 | 001368 | 通达创智   | 3,900  | 80,223.00 | 0.01 |
| 421 | 002910 | 庄园牧场   | 6,800  | 75,344.00 | 0.01 |
| 422 | 002050 | 三花智控   | 1,700  | 74,511.00 | 0.01 |
| 423 | 300604 | 长川科技   | 200    | 68,284.00 | 0.00 |
| 424 | 603787 | 新日股份   | 7,200  | 65,448.00 | 0.00 |
| 425 | 601996 | 丰林集团   | 26,800 | 55,476.00 | 0.00 |
| 426 | 600873 | 梅花生物   | 6,100  | 44,835.00 | 0.00 |
| 427 | 002465 | 海格通信   | 2,800  | 35,756.00 | 0.00 |
| 428 | 002402 | 和而泰    | 1,300  | 33,579.00 | 0.00 |
| 429 | 002813 | 路畅科技   | 1,600  | 30,240.00 | 0.00 |
| 430 | 002995 | 天地在线   | 1,700  | 30,056.00 | 0.00 |
| 431 | 600202 | 哈空调    | 5,500  | 24,640.00 | 0.00 |
| 432 | 601668 | XD 中国建 | 5,100  | 22,134.00 | 0.00 |
| 433 | 000001 | 平安银行   | 1,600  | 16,080.00 | 0.00 |
| 434 | 002829 | 星网宇达   | 900    | 15,804.00 | 0.00 |
| 435 | 002353 | 杰瑞股份   | 100    | 15,250.00 | 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  | 300308 | 中际旭创 | 7,548,822.00 | 0.50           |
| 2  | 600487 | 亨通光电 | 7,148,113.00 | 0.47           |
| 3  | 002384 | 东山精密 | 5,946,954.00 | 0.39           |
| 4  | 000338 | 潍柴动力 | 5,943,552.00 | 0.39           |
| 5  | 688498 | 源杰科技 | 5,411,332.91 | 0.36           |
| 6  | 300418 | 昆仑万维 | 5,384,111.00 | 0.35           |
| 7  | 002028 | 思源电气 | 4,972,113.00 | 0.33           |
| 8  | 600111 | 北方稀土 | 4,795,724.00 | 0.32           |
| 9  | 002938 | 鹏鼎控股 | 4,617,810.48 | 0.30           |
| 10 | 002460 | 赣锋锂业 | 4,468,006.00 | 0.29           |
| 11 | 002466 | 天齐锂业 | 4,463,248.40 | 0.29           |
| 12 | 000426 | 兴业银锡 | 4,442,455.89 | 0.29           |
| 13 | 600309 | 万华化学 | 4,409,809.00 | 0.29           |
| 14 | 300390 | 天华新能 | 4,406,632.37 | 0.29           |
| 15 | 688008 | 澜起科技 | 4,405,961.93 | 0.29           |
| 16 | 300408 | 三环集团 | 4,369,464.00 | 0.29           |
| 17 | 600176 | 中国巨石 | 4,160,870.00 | 0.27           |
| 18 | 300502 | 新易盛  | 4,048,911.00 | 0.27           |
| 19 | 300274 | 阳光电源 | 3,950,097.00 | 0.26           |
| 20 | 600989 | 宝丰能源 | 3,910,956.00 | 0.26           |



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  | 600487 | 亨通光电 | 7,037,627.00 | 0.46           |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 5,764,061.00 | 0.38           |
| 3  | 002938 | 鹏鼎控股 | 5,629,318.60 | 0.37           |
| 4  | 600176 | 中国巨石 | 5,520,659.00 | 0.36           |
| 5  | 002463 | 沪电股份 | 5,502,754.14 | 0.36           |
| 6  | 002384 | 东山精密 | 5,432,039.00 | 0.36           |
| 7  | 000338 | 潍柴动力 | 5,380,059.00 | 0.35           |
| 8  | 300274 | 阳光电源 | 5,298,066.92 | 0.35           |
| 9  | 002466 | 天齐锂业 | 5,158,476.00 | 0.34           |
| 10 | 300033 | 同花顺  | 4,913,532.60 | 0.32           |
| 11 | 603986 | 兆易创新 | 4,873,924.00 | 0.32           |
| 12 | 300390 | 天华新能 | 4,828,566.00 | 0.32           |
| 13 | 001309 | 德明利  | 4,585,802.57 | 0.30           |
| 14 | 002028 | 思源电气 | 4,571,409.00 | 0.30           |
| 15 | 300418 | 昆仑万维 | 4,536,528.32 | 0.30           |
| 16 | 300408 | 三环集团 | 4,452,714.00 | 0.29           |
| 17 | 002008 | 大族激光 | 4,214,202.00 | 0.28           |
| 18 | 002371 | 北方华创 | 4,177,231.50 | 0.27           |
| 19 | 688498 | 源杰科技 | 4,149,503.71 | 0.27           |
| 20 | 600111 | 北方稀土 | 4,136,935.00 | 0.27           |

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。

7.4.3 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 | 1,367,551,082.32 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,411,110,214.01 |

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      | 105,452.44     | 0.01         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 529,507,972.04 | 36.58        |
|    | 其中：政策性金融债 | 80,936,942.46  | 5.59         |
| 4  | 企业债券      | 50,415,328.77  | 3.48         |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -     |
| 6  | 中期票据      | 778,214,909.04   | 53.75 |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -     |
| 8  | 同业存单      | -                | -     |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 1,358,243,662.29 | 93.82 |

## 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  | 092280080 | 22 光大银行二级资本债 01A | 900,000 | 93,968,210.96 | 6.49         |
| 2  | 092280139 | 22 交行二级资本债 02A   | 800,000 | 83,131,335.89 | 5.74         |
| 3  | 092280098 | 22 杭州银行二级资本债 01  | 700,000 | 73,065,041.10 | 5.05         |
| 4  | 250431    | 25 农发 31         | 700,000 | 70,888,367.12 | 4.90         |
| 5  | 102482378 | 24 闽能源 MTN003    | 700,000 | 70,520,297.53 | 4.87         |

## 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、交通银行股份有限公司、中国农业发展银行、宁波银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国建设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 | 107,580.23 |
| 2  | 应收清算款 | 257,491.61 |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 6,412.95   |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 371,484.79 |

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

| 份额级别 | 持有人户数 | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |       |
|------|-------|-----------|-------|-------|
|      |       |           | 机构投资者 | 个人投资者 |

|              | (户) |              | 持有份额             | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总份<br>额比例<br>(%) |
|--------------|-----|--------------|------------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 太平嘉裕<br>债券 A | 432 | 2,902,510.91 | 1,144,047,818.96 | 91.2403           | 109,836,892.65 | 8.7597            |
| 太平嘉裕<br>债券 C | 308 | 422,466.77   | 67,366,885.15    | 51.7730           | 62,752,879.21  | 48.2270           |
| 合计           | 735 | 1,882,999.29 | 1,211,414,704.11 | 87.5297           | 172,589,771.86 | 12.4703           |

注：在同一基金账号同时持有 A 类份额和 C 类份额的情况下，按一户统计持有人户数。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                           | 份额级别     | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------------------|----------|-----------|-------------|
| 基金管<br>理人所有从业<br>人员持有本基<br>金 | 太平嘉裕债券 A | 94,856.84 | 0.0076      |
|                              | 太平嘉裕债券 C | 4.00      | 0.0000      |
|                              | 合计       | 94,860.84 | 0.0069      |

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                                         | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、<br>基金投资和相关部门<br>负责人持有本开放式<br>基金 | 太平嘉裕债券 A | 0                 |
|                                            | 太平嘉裕债券 C | 0                 |
|                                            | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金                        | 太平嘉裕债券 A | 0~10              |
|                                            | 太平嘉裕债券 C | 0                 |
|                                            | 合计       | 0~10              |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 太平嘉裕债券 A         | 太平嘉裕债券 C       |
|----------------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>（2025 年 9 月 23 日）<br>基金份额总额 | 1,349,910,012.46 | 449,345,703.60 |
| 本报告期期初基金份<br>额总额                       | 1,249,677,269.64 | 250,206,902.67 |
| 本报告期基金总申购<br>份额                        | 392,872,674.58   | 104,072,069.73 |

|               |                  |                |
|---------------|------------------|----------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 388,665,232.61   | 224,159,208.04 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 1,253,884,711.61 | 130,119,764.36 |

§ 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

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及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的基金托管业务履职不涉及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 (%) |    |
| 广发证券 | 2      | 2,085,452,326.18 | 75.05            | 417,101.01 | 75.05          | -  |
| 国金证券 | 1      | 362,931,719.24   | 13.06            | 72,586.41  | 13.06          | -  |
| 兴业证券 | 2      | -                | -                | -          | -              | -  |
| 浙商证券 | 1      | 330,277,250.91   | 11.89            | 66,058.56  | 11.89          | -  |

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。

3. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

本报告期内本基金新增租用广发证券 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 (%) |
| 广发证券 | -             | -                | 1,812,000,000.00 | 96.28              | -    | -                |
| 国金证券 | -             | -                | 70,000,000.00    | 3.72               | -    | -                |
| 兴业证券 | 50,205,500.00 | 100.00           | -                | -                  | -    | -                |
| 浙商证券 | -             | -                | -                | -                  | -    | -                |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                         | 法定披露方式    | 法定披露日期          |
|----|------------------------------|-----------|-----------------|
| 1  | 太平嘉裕债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2026 年 1 月 22 日 |
| 2  | 太平嘉裕债券型证券投资基金 2025 年年度报告     | 中国证监会规定媒介 | 2026 年 3 月 31 日 |
| 3  | 太平嘉裕债券型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 |
| 4  | 太平嘉裕债券型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 |
| 5  | 太平嘉裕债券型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  | 太平嘉裕债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2026 年 4 月 22 日 |

§ 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 -<br>20260630 | 766,905,7<br>98.63 | - | - | 766,905,798.6<br>3 | 55.41<br>21 |
| 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、《太平嘉裕债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平嘉裕债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平嘉裕债券型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