

太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资
基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2023 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，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47

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	47
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	47
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	太平改革红利精选
基金主代码	005270
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 1 日
基金管理人	太平基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	153,181,250.32 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，把握改革红利带来的投资机会，力求获得长期资本增值和超额收益。
投资策略	1. 资产配置策略 本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券等资产类别的配置比例。 在资产配置中，本基金主要考虑：（1）国内外宏观经济走势，主要通过对 GDP 增速、工业增加值、物价水平、市场利率水平等宏观经济指标的分析，判断实体经济在经济周期中所处的阶段；（2）市场估值与流动性，紧密跟踪国内外市场整体估值变化，货币供应量增速变化及其对市场整体资金供求的可能影响；（3）政策因素，密切关注宏观经济与产业经济层面相关政策的政策导向及其变化对市场和相关产业的影响。 2. 股票投资策略 （1）改革红利主题的界定 本基金所指的“改革红利”，是指在国家、经济、社会等多维度发展进程中，通过机制变革和创新，释放出超过原有资源分配方式价值形态的各种有利因素的总称。改革领域正逐步延伸至经济、社会、科技、文化、生态等多方面，释放改革红利不仅是发展的需要，同时存在较大的潜力空间，本基金将长期关注、动态跟踪受益于改革红利从而提升竞争力和盈利能力的行业和企业。具体包括：国企改革、供给侧改革、金融市场改革、户籍制度改革，文教体卫领域改革等内容，主要涉及具备国企改革预期的企业、金融、文娱教育、医疗养老、节能环保、新能源等行业公司。未来随着技术进步、业务创新、政策调整及其他市场因素等，改革红利概念的外延将会逐渐扩大，本基金可根据实际情况调整对上述行业界定。 本基金将动态调整改革红利主题的范畴，如果未来基金管理人认为有更适当的改革红利主题界定标准，基金管理人将在审慎研究的基础上，对改革红利的界定方法进行变更。 （2）行业配置 本基金重点关注因改革而受益的相关行业企业，包括但不限于：

	1) 受益于供给侧结构性改革的企业。加强供给侧结构性改革,有助于破除机制体制障碍,提高供给体系的质量和效率,增强持续增长动力,本基金重点关注过剩产能出清顺利,中高端供给改善,从而带来竞争力和盈利能力双提升的行业和公司。 2) 受益于国企制度改革的企业。本基金重点关注通过兼并重组、引入多元股权、实施股权激励、资产注入、整体上市、市场化管理等改革方式,以提升其市场竞争力的中央或地方政府直接或间接控股或参与控制的企业。 3) 受益于户籍制度及生育养老政策改革的企业。深化户籍制度改革,有利于推进新型城镇化建设进程。生育养老政策改革,带来医疗养老、教育传媒等行业的需求升级。本基金重点关注户籍制度和生育养老政策改革过程中的上述相关受益领域的企业。 4) 受益于资源要素改革的企业。综合考虑社会体制、经济效益、环境影响及战略定位等因素,对土地、原材料、能源等资源要素进行改革,有利于提高和改善社会资源配置效率,通过生产要素效率的改进培植经济增长新动力。本基金重点关注农村土地资源配置、新材料、新能源及设备、节能环保等受益行业; 同时,本基金将对受益于改革红利的相关行业领域进行密切跟踪,随着改革的不断深入,改革的范围和受益行业领域也会做出动态调整。本基金将根据实际情况更新调整改革红利相关行业领域的范畴。 (3) 个股选择 本基金在行业配置的基础上,依靠定量与定性相结合的方法进行个股精选。基金经理将结合定量以及定性指标的基本结论选择具有竞争优势且估值合理的标的,组件并动态调整本基金股票库。基金管理人将按投资决策程序,权衡风险与收益,组建并动态调整组合。定性分析主要基于企业的战略定位、市场布局、客户定位、研发实力、销售渠道、治理状况、商业模式、核心竞争力等多项要素评判,分析企业的核心价值和成长能力,选择具有良好经营状况的上市公司股票。 定量的方法主要基于考核其量化指标,包括:市盈率(P/E)、市净率(P/B)、动态市盈率(PEG)、企业价值/息税折旧摊销前利润(EV/EBITDA)、主营业务收入增长率,净利润增长率等,并强调绝对估值方法(现金流贴现模型(DCF)或股利贴现模型(DDM)等)与相对估值方法(P/B、P/E、PEG等)的结合。通过估值水平分析,基金管理人力争发掘出价值被低估或估值合理的股票。 3、债券投资策略 (1) 在债券投资方面,本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次,本基金结合对宏观经济、市场利率、供求变化等因素的综合分析,根据交易所市场与银行间市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。 在券种选择上,本基金以长期利率趋势分析为基础,结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,实施积极主动的债券投资管理。 随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁,更多债券新品种和交
--	---

	易形式将增加债券投资盈利模式，本基金将密切跟踪市场动态变化，选择合适的介入机会，谋求高于市场平均水平的投资回报。 (2) 证券公司短期公司债券投资策略 本基金将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，确定投资决策。此外，本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，并适当控制债券投资组合整体的久期，保证本基金的流动性。 (3) 中小企业私募债投资策略 本基金在控制信用风险的基础上，对中小企业私募债进行投资，主要采取分散化投资策略，控制个债持有比例。同时，紧密跟踪研究发债企业的基本面情况变化，并据此调整投资组合，控制投资风险。 4、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。 5、衍生产品投资策略 (1) 股指期货投资策略 本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。 (2) 权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。 (3) 股票期权投资策略 股票期权为本基金辅助投资工具。股票期权的投资原则为控制下跌风险，降低建仓或调仓过程中的冲击成本。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		太平基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵霖	朱萍
	联系电话	021-38556613	021-31888888
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		021-61560999/400-028-8699	95528
传真		021-38556677	021-63602540
注册地址		上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢	上海市中山东一路 12 号

	101 室	
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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	200120	200126
法定代表人	焦艳军	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	太平基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	20,926,474.25
本期利润	7,800,213.48
加权平均基金份额本期利润	0.0554
本期加权平均净值利润率	3.79%
本期基金份额净值增长率	4.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	65,218,805.77
期末可供分配基金份额利润	0.4258
期末基金资产净值	218,400,056.09
期末基金份额净值	1.4258
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	53.89%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

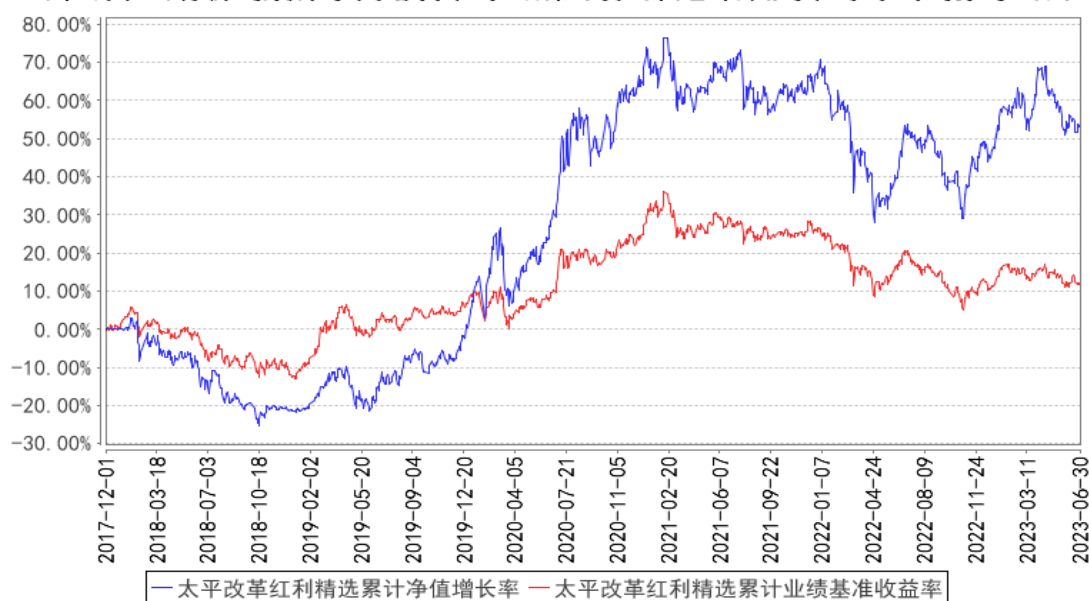
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.97%	0.86%	0.93%	0.51%	1.04%	0.35%
过去三个月	-6.49%	0.87%	-2.31%	0.49%	-4.18%	0.38%
过去六个月	4.18%	0.99%	0.83%	0.50%	3.35%	0.49%
过去一年	0.37%	1.02%	-6.94%	0.59%	7.31%	0.43%
过去三年	17.12%	1.21%	1.42%	0.72%	15.70%	0.49%
自基金合同生效起至今	53.89%	1.22%	12.23%	0.75%	41.66%	0.47%

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

太平改革红利精选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：本基金基金合同于 2017 年 12 月 1 日生效。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立，2016 年 8 月 22 日更名为太平基金管理有限公司。截至本报告期末，

公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 33 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		
梁鹏	本基金的基金经理、太平价值增长股票型证券投资基金基金经理、太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金基金经理	2017 年 12 月 1 日	—	11 年	中国科学院环境科学博士及法国奥尔良大学大气化学博士。具有证券投资基金从业资格。2012 年 6 月起历任申万宏源证券研究所高级分析师，新华联集团新活力资本投资有限公司投资副总监等职。2016 年 2 月加入本公司，从事投资研究相关工作。2017 年 12 月 1 日起任太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 21 日起任太平价值增长股票型证券投资基金基金经理。2021 年 8 月 25 日起担任太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期一般情况下根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定；

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如日内、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

2023 年上半年，市场整体呈现“倒 V”型走势，尤其 2 季度，几个宽基指数单边下跌。但结构性板块行情显著，人工智能事件驱动影响，TMT 相关行业的涨幅名列前茅。本基金由于 22 年 4 季度布局了传媒等子板块（详见 2022 年度报告），净值展现一定的超额收益。但随着传媒板块的快速上涨达到价值中枢位，风险收益比弱化，本基金于 4 月份兑现了部分传媒板块的收益，增加了化工和农林牧渔等行业的布局。

本基金将继续遵循基本原则：1) 将风险控制置于收益追求之上；2) 劣质的不碰，高估的不买；3) 自下而上应用“四度选股方法”。以企业价值为评估标准，重视风险收益比，均衡配置，期望于以较小的风险承受为代价，来追求超越市场平均水平的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 4.18%，同期业绩比较基准收益率为 0.83%。

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 2023 年下半年，我们认为经济韧性仍将保持，经济有望呈现缓慢修复的态势。且经过 2 季度的调整，低估值顺周期行业板块具有较好的风险收益特征，具备经营修复和估值回升等带来的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，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的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值与产品委员会下设估值分委会，常任委员由稽核风控部、投资部门、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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面

进行了认真的复核，未发现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的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由太平基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	45,646,516.69	30,095,931.99
结算备付金		261,290.28	436,227.72
存出保证金		71,753.08	72,259.43
交易性金融资产	6.4.7.2	177,849,344.01	159,854,669.66
其中：股票投资		177,849,344.01	159,854,669.66
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
债权投资	6.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		1,188,311.00	99.85
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		225,017,215.06	190,459,188.65
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,982,381.25	-
应付赎回款		199.00	1,606.08
应付管理人报酬		262,445.13	240,616.56
应付托管费		43,740.88	40,102.76
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	328,392.71	362,949.52
负债合计		6,617,158.97	645,274.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	153,181,250.32	138,687,910.25
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	65,218,805.77	51,126,003.48
净资产合计		218,400,056.09	189,813,913.73
负债和净资产总计		225,017,215.06	190,459,188.65

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4258 元，基金份额总额 153,181,250.32 份。

6.2 利润表

会计主体：太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,669,556.43	-17,671,643.18
1. 利息收入		62,228.79	46,672.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	62,228.79	46,672.64
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		22,732,412.62	-11,326,834.14

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.14	21,019,259.98	-12,588,220.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,713,152.64	1,261,386.67
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-13,126,260.77	-6,393,244.35
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	1,175.79	1,762.67
减：二、营业总支出		1,869,342.95	1,733,366.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,531,256.61	1,411,320.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	255,209.46	235,220.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	82,876.88	86,825.90
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		7,800,213.48	-19,405,009.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		7,800,213.48	-19,405,009.21
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		7,800,213.48	-19,405,009.21

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	138,687,910.25	-	51,126,003.48	189,813,913.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	138,687,910.25	-	51,126,003.48	189,813,913.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	14,493,340.07	-	14,092,802.29	28,586,142.36
(一)、综合收益总额	-	-	7,800,213.48	7,800,213.48
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	14,493,340.07	-	6,292,588.81	20,785,928.88
其中：1. 基金申购款	14,812,108.45	-	6,443,808.04	21,255,916.49
2. 基金赎回款	-318,768.38	-	-151,219.23	-469,987.61
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	153,181,250.32	-	65,218,805.77	218,400,056.09
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	138,651,257.96	-	77,678,378.29	216,329,636.25
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	138,651,257.96	-	77,678,378.29	216,329,636.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	29,425.86	-	-19,355,832.01	-19,326,406.15
（一）、综合收益总额	-	-	-19,405,009.21	-19,405,009.21
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	29,425.86	-	49,177.20	78,603.06
其中：1. 基金申购款	684,792.83	-	268,633.81	953,426.64
2. 基金赎回款	-655,366.97	-	-219,456.61	-874,823.58
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	138,680,683.82	-	58,322,546.28	197,003,230.10

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：

邓先虎

邓先虎

王瑞瑾

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金(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[2017]626 号《关于准予太平改革红利精选灵活配置

混合型证券投资基金注册的批复》核准，由太平基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平改革红利精选灵活配置混合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，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 299,388,530.06 元，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 1066 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 1 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 299,416,373.03 份基金份额，其中认购资金利息折合 27,842.97 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平改革红利精选灵活配置混合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国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板和其他经中国证监会批准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 0%—95%，扣除股指期货合约与股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金投资于改革红利相关主题证券相关资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继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》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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》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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后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费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	45,646,516.69
等于：本金	45,641,273.34
加：应计利息	5,243.35
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	45,646,516.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	182,402,376.79	—	177,849,344.01	-4,553,032.78
贵金属投资—金交所黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	182,402,376.79	—	177,849,344.01	-4,553,032.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有任何期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有任何黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金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

本基金本报告期末未计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.25
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	135,000.58
其中：交易所市场	135,000.58
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	179,507.37
预提审计费	13,884.51
合计	328,392.71

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	138,687,910.25	138,687,910.25
本期申购	14,812,108.45	14,812,108.45
本期赎回（以“-”号填列）	-318,768.38	-318,768.38
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	153,181,250.32	153,181,250.32

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 其他综合收益

本基金于本报告期内未发生其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,376,562.90	10,749,440.58	51,126,003.48
本期利润	20,926,474.25	-13,126,260.77	7,800,213.48
本期基金份额交易产生的变动数	6,465,085.39	-172,496.58	6,292,588.81
其中：基金申购款	6,587,782.51	-143,974.47	6,443,808.04

基金赎回款	-122,697.12	-28,522.11	-151,219.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,768,122.54	-2,549,316.77	65,218,805.77

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	58,596.26
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	3,044.40
其他	588.13
合计	62,228.79

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	21,019,259.98
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	21,019,259.98

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	245,971,288.90
减：卖出股票成本总额	224,354,338.17
减：交易费用	597,690.75
买卖股票差价收入	21,019,259.98

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金在本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,713,152.64
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	1,713,152.64

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-13,126,260.77
股票投资	-13,126,260.77
债券投资	-
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	-13,126,260.77

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,174.69
基金转换费收入	1.10
合计	1,175.79

6.4.7.22 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	13,884.51
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行划款手续费	485.00
账户维护费	9,000.00
合计	82,876.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金自 2023 年 8 月 1 日起，管理费率调整至 1.20%，托管费率调整至 0.20%。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
太平基金管理有限公司（“太平基金”）	基金管理人、基金销售机构、登记机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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

本基金在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

本基金在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

本基金在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

本基金在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

本基金在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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,531,256.61	1,411,320.09
其中：支付销售机构的客户维护费	30,399.91	22,216.70

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	255,209.46	235,220.04

注：支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

本基金在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

本基金在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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
太平人寿	100,002,750.00	65.2839	100,002,750.00	72.1063

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	45,646,516.69	58,596.26	20,957,428.29	43,740.14

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦发银行保管，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

本基金在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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	N 三联锻	2023 年 5 月 15 日	6 个月	限售期股票	27.93	33.03	68	1,899.24	2,246.04	-

001286	C 陕西能	2023 年 3 月 31 日	6 个月	限售期股票	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	C 中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	限售期股票	11.88	21.02	271	3,219.48	5,696.42	-
001324	N 长青科	2023 年 5 月 12 日	6 个月	限售期股票	18.88	19.60	98	1,850.24	1,920.80	-
001328	C 登康	2023 年 3 月 29 日	6 个月	限售期股票	20.68	25.49	80	1,654.40	2,039.20	-
001360	C 南矿	2023 年 3 月 31 日	6 个月	限售期股票	15.38	14.87	114	1,753.32	1,695.18	-
001367	C 海森	2023 年 3 月 30 日	6 个月	限售期股票	44.48	39.48	37	1,645.76	1,460.76	-
001380	C 华纬	2023 年 5 月 9 日	6 个月	限售期股票	28.84	30.78	112	3,230.08	3,447.36	-
301203	C 国泰环	2023 年 3 月 28 日	6 个月	限售期股票	46.13	34.40	131	6,043.03	4,506.40	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	限售期股票	50.00	30.71	193	9,650.00	5,927.03	-
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	限售期股票	30.85	23.63	286	8,823.10	6,758.18	-
301281	C 科源	2023 年 3 月 28 日	6 个月	限售期股票	44.18	25.10	170	5,345.78	4,267.00	-

301293	C 三博	2023 年 4 月 25 日	6 个月	限售期股票	29.60	71.42	180	5,328.00	12,855.60	-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	限售期股票	26.80	22.32	302	8,093.60	6,740.64	-
301305	N 朗坤	2023 年 5 月 15 日	6 个月	限售期股票	25.25	19.69	268	6,767.00	5,276.92	-
301325	C 曼恩	2023 年 5 月 4 日	6 个月	限售期股票	76.80	107.95	100	7,680.00	10,795.00	-
301332	N 德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	限售期股票	14.81	13.73	416	6,160.96	5,711.68	-
301337	N 亚华	2023 年 5 月 16 日	6 个月	限售期股票	32.60	30.37	142	4,629.20	4,312.54	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	限售期股票	73.45	46.64	63	4,627.35	2,938.32	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	限售期股票	23.77	42.89	218	5,181.86	9,350.02	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	限售期股票	33.73	31.85	159	5,363.07	5,064.15	-
301382	C 蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	限售期股票	23.80	32.84	229	5,450.20	7,520.36	-
301386	C 未来	2023 年 3 月 21 日	6 个月	限售期股票	29.99	23.79	186	5,578.14	4,424.94	-

301387	C 光大同	2023 年 4 月 10 日	6 个月	限售期股票	58.32	45.36	148	8,631.36	6,713.28	-
301399	N 英特科	2023 年 5 月 16 日	6 个月	限售期股票	43.99	51.57	153	6,730.47	7,890.21	-
301428	N 世纪	2023 年 5 月 10 日	6 个月	限售期股票	26.35	30.60	178	4,690.30	5,446.80	-
301429	C 森泰	2023 年 4 月 10 日	6 个月	限售期股票	28.75	21.02	300	8,625.00	6,306.00	-
601061	C 中信金	2023 年 3 月 30 日	6 个月	限售期股票	6.58	7.58	599	3,941.42	4,540.42	-
601065	C 江盐	2023 年 3 月 31 日	6 个月	限售期股票	10.36	11.84	216	2,237.76	2,557.44	-
601133	C 柏诚	2023 年 3 月 31 日	6 个月	限售期股票	11.66	12.26	186	2,168.76	2,280.36	-
603125	C 常青	2023 年 3 月 30 日	6 个月	限售期股票	25.98	24.53	64	1,662.72	1,569.92	-
603135	C 中重	2023 年 3 月 29 日	6 个月	限售期股票	17.80	17.89	199	3,542.20	3,560.11	-
603172	C 万丰	2023 年 4 月 28 日	6 个月	限售期股票	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	C 中船	2023 年 4 月 13 日	6 个月	限售期股票	36.15	38.13	191	6,904.65	7,282.83	-

688334	N 西 高 院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	限售 期股 票	14.16	16.21	429	6,074.64	6,954.09	-
688343	C 云 天	2023 年 3 月 28 日	6 个月	限售 期股 票	43.92	50.67	2,496	109,624.32	126,472.32	-
688352	C 颀 中	2023 年 4 月 11 日	6 个月	限售 期股 票	12.10	12.07	579	7,005.90	6,988.53	-
688361	N 飞 测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	限售 期股 票	23.60	64.67	220	5,192.00	14,227.40	-
688433	C 华 曙	2023 年 4 月 7 日	6 个月	限售 期股 票	26.66	31.50	152	4,052.32	4,788.00	-
688443	N 智 翔	2023 年 6 月 13 日	6 个月	限售 期股 票	37.88	29.49	278	10,530.64	8,198.22	-
688458	N 美 芯 晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	限售 期股 票	75.00	90.76	74	5,550.00	6,716.24	-
688469	C 中 芯	2023 年 4 月 28 日	6 个月	限售 期股 票	5.69	5.41	1,877	10,680.13	10,154.57	-
688472	N 阿 特 斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	限售 期股 票	11.10	17.04	793	8,802.30	13,512.72	-
688479	C 友 车	2023 年 5 月 4 日	6 个月	限售 期股 票	33.99	29.49	139	4,724.61	4,099.11	-
688484	C 南 芯	2023 年 3 月 28 日	6 个月	限售 期股 票	39.99	36.71	170	6,798.30	6,240.70	-

688485	九州一轨	2023年1月11日	6个月	限售期股票	17.47	15.17	2,733	47,745.51	41,459.61	-
688512	C 慧智微	2023年5月8日	6个月	限售期股票	20.92	19.16	256	5,355.52	4,904.96	-
688523	N 环宇	2023年5月26日	6个月	限售期股票	21.86	23.85	262	5,727.32	6,248.70	-
688535	C 华海	2023年3月28日	6个月	限售期股票	35.00	51.23	124	4,340.00	6,352.52	-
688543	N 国科	2023年6月14日	6个月	限售期股票	43.67	53.05	134	5,851.78	7,108.70	-
688552	N 南湖	2023年5月8日	6个月	限售期股票	21.17	23.50	273	5,779.41	6,415.50	-
688562	N 航天	2023年5月15日	6个月	限售期股票	12.68	22.31	404	5,122.72	9,013.24	-
688570	N 天玛	2023年5月29日	6个月	限售期股票	30.26	25.33	204	6,173.04	5,167.32	-
688576	N 西山	2023年5月30日	6个月	限售期股票	135.80	120.41	57	7,740.60	6,863.37	-
688581	N 安杰思	2023年5月12日	6个月	限售期股票	125.80	118.03	46	5,786.80	5,429.38	-
688582	N 芯动	2023年6月21日	6个月	限售期股票	26.74	40.68	205	5,481.70	8,339.40	-

688593	N 新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	限售期股票	11.18	14.59	551	6,160.18	8,039.09	-
688603	N 天承	2023 年 6 月 30 日	1-6 个月(含)	新股未上市	55.00	55.00	938	51,590.00	51,590.00	-
688623	N 双元	2023 年 5 月 31 日	6 个月	限售期股票	125.88	86.79	44	5,538.72	3,818.76	-
688631	N 莱斯	2023 年 6 月 19 日	6 个月	限售期股票	25.28	29.87	150	3,792.00	4,480.50	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括

股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货、权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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在本基金的托管人浦发银行，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。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

截至本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流动暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	45,646,516.69	-	-	-	45,646,516.69
结算备付金	261,290.28	-	-	-	261,290.28
存出保证金	71,753.08	-	-	-	71,753.08
交易性金融资产	-	-	-	177,849,344.01	177,849,344.01
应收申购款	-	-	-	1,188,311.00	1,188,311.00
资产总计	45,979,560.05	-	-	179,037,655.01	225,017,215.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	199.00	199.00
应付管理人报酬	-	-	-	262,445.13	262,445.13
应付托管费	-	-	-	43,740.88	43,740.88
应付清算款	-	-	-	5,982,381.25	5,982,381.25
其他负债	-	-	-	328,392.71	328,392.71
负债总计	-	-	-	6,617,158.97	6,617,158.97
利率敏感度缺口	45,979,560.05	-	-	172,420,496.04	218,400,056.09
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	30,095,931.99	-	-	-	30,095,931.99
结算备付金	436,227.72	-	-	-	436,227.72
存出保证金	72,259.43	-	-	-	72,259.43
交易性金融资产	-	-	-	159,854,669.66	159,854,669.66
应收申购款	-	-	-	99.85	99.85
资产总计	30,604,419.14	-	-	159,854,769.51	190,459,188.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,606.08	1,606.08
应付管理人报酬	-	-	-	240,616.56	240,616.56
应付托管费	-	-	-	40,102.76	40,102.76
其他负债	-	-	-	362,949.52	362,949.52
负债总计	-	-	-	645,274.92	645,274.92
利率敏感度缺口	30,604,419.14	-	-	159,209,494.59	189,813,913.73

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有债券（2022 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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投资比例为基金总资产的 0-95%，扣除股指期货合约与股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金投资于改革红利相关主题证券相关资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	177,849,344.01	81.43	159,854,669.66	84.22

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	177,849,344.01	81.43	159,854,669.66	84.22

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	7,850,898.00	8,523,357.00
	沪深 300 指数下降 5%	-7,850,898.00	-8,523,357.00

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	177,265,243.82	156,862,839.90
第二层次	584,100.19	2,991,829.76
第三层次	—	—
合计	177,849,344.01	159,854,669.66

6.4.14.2 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 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2022 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 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	177,849,344.01	79.04
	其中：股票	177,849,344.01	79.04
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	45,907,806.97	20.40
8	其他各项资产	1,260,064.08	0.56
9	合计	225,017,215.06	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	35,113,045.00	16.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	87,333,497.21	39.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,279,797.47	3.79
E	建筑业	2,280.36	0.00
F	批发和零售业	10,236.84	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	9,084,000.00	4.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	211,509.82	0.10
J	金融业	28,675,020.00	13.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,057,300.00	4.15
M	科学研究和技术服务业	11,793.33	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	51,242.93	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,621.05	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	177,849,344.01	81.43

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	603225	新凤鸣	1,330,000	14,696,500.00	6.73
2	600160	巨化股份	933,000	12,856,740.00	5.89
3	002567	唐人神	1,933,300	12,856,445.00	5.89
4	600975	新五丰	1,330,000	12,714,800.00	5.82
5	603477	巨星农牧	366,000	12,206,100.00	5.59
6	601601	中国太保	433,000	11,249,340.00	5.15
7	601233	桐昆股份	833,059	11,038,031.75	5.05
8	002100	天康生物	1,333,000	10,997,250.00	5.04
9	601318	中国平安	200,000	9,280,000.00	4.25

10	600009	上海机场	200,000	9,084,000.00	4.16
11	002027	分众传媒	1,330,000	9,057,300.00	4.15
12	601628	中国人寿	233,000	8,145,680.00	3.73
13	300498	温氏股份	433,000	7,945,550.00	3.64
14	603379	三美股份	333,000	7,828,830.00	3.58
15	002493	荣盛石化	633,000	7,368,120.00	3.37
16	600027	华电国际	633,000	4,234,770.00	1.94
17	600011	华能国际	433,000	4,009,580.00	1.84
18	600519	贵州茅台	2,300	3,889,300.00	1.78
19	605077	华康股份	100,000	2,648,000.00	1.21
20	002597	金禾实业	99,936	2,358,489.60	1.08
21	002714	牧原股份	53,300	2,246,595.00	1.03
22	688498	源杰科技	689	196,365.00	0.09
23	688343	C 云天	2,496	126,472.32	0.06
24	688372	伟测科技	733	112,258.95	0.05
25	688362	甬矽电子	2,606	86,753.74	0.04
26	688603	N 天承	938	51,590.00	0.02
27	301337	N 亚华	1,419	48,241.34	0.02
28	688485	九州一轨	2,733	41,459.61	0.02
29	001286	C 陕西能	3,767	35,447.47	0.02
30	301368	丰立智能	247	17,089.93	0.01
31	688361	N 飞测	220	14,227.40	0.01
32	301301	川宁生物	1,577	14,129.92	0.01
33	301311	昆船智能	465	13,708.20	0.01
34	688472	N 阿特斯	793	13,512.72	0.01
35	301293	C 三博	180	12,855.60	0.01
36	301325	C 曼恩	100	10,795.00	0.00
37	688469	C 中芯	1,877	10,154.57	0.00
38	301358	湖南裕能	218	9,350.02	0.00
39	688562	N 航天	404	9,013.24	0.00
40	688582	N 芯动	205	8,339.40	0.00
41	688443	N 智翔	278	8,198.22	0.00
42	688593	N 新相微	551	8,039.09	0.00
43	301399	N 英特科	153	7,890.21	0.00
44	301359	东南电子	309	7,873.32	0.00
45	301382	C 蜂助手	229	7,520.36	0.00
46	688146	C 中船	191	7,282.83	0.00
47	688543	N 国科	134	7,108.70	0.00
48	688352	C 颀中	579	6,988.53	0.00
49	688334	N 西高院	429	6,954.09	0.00
50	688576	N 西山	57	6,863.37	0.00
51	301267	华夏眼科	111	6,765.45	0.00
52	301260	格力博	286	6,758.18	0.00

53	301303	真兰仪表	302	6,740.64	0.00
54	688458	N 美芯晟	74	6,716.24	0.00
55	301387	C 光大同	148	6,713.28	0.00
56	688552	N 南湖	273	6,415.50	0.00
57	688535	C 华海	124	6,352.52	0.00
58	301429	C 森泰	300	6,306.00	0.00
59	688523	N 环宇	262	6,248.70	0.00
60	688484	C 南芯	170	6,240.70	0.00
61	301396	宏景科技	191	6,236.15	0.00
62	301367	怡和嘉业	42	6,230.28	0.00
63	301398	星源卓镁	166	6,225.00	0.00
64	301277	新天地	312	6,087.12	0.00
65	301246	宏源药业	193	5,927.03	0.00
66	301389	隆扬电子	324	5,890.32	0.00
67	301332	N 德尔玛	416	5,711.68	0.00
68	001287	C 中电港	271	5,696.42	0.00
69	301428	N 世纪	178	5,446.80	0.00
70	301280	珠城科技	152	5,435.52	0.00
71	688581	N 安杰思	46	5,429.38	0.00
72	301305	N 朗坤	268	5,276.92	0.00
73	301335	天元宠物	220	5,244.80	0.00
74	688570	N 天玛	204	5,167.32	0.00
75	301373	凌玮科技	159	5,064.15	0.00
76	688512	C 慧智微	256	4,904.96	0.00
77	301365	矩阵股份	294	4,839.24	0.00
78	688433	C 华曙	152	4,788.00	0.00
79	301290	东星医疗	145	4,647.25	0.00
80	601061	C 中信金	599	4,540.42	0.00
81	301203	C 国泰环	131	4,506.40	0.00
82	688631	N 莱斯	150	4,480.50	0.00
83	301386	C 未来	186	4,424.94	0.00
84	301281	C 科源	170	4,267.00	0.00
85	301265	华新环保	354	4,113.48	0.00
86	688479	C 友车	139	4,099.11	0.00
87	688623	N 双元	44	3,818.76	0.00
88	603135	C 中重	199	3,560.11	0.00
89	001380	C 华纬	112	3,447.36	0.00
90	301345	涛涛车业	63	2,938.32	0.00
91	601065	C 江盐	216	2,557.44	0.00
92	601133	C 柏诚	186	2,280.36	0.00
93	001282	N 三联锻	68	2,246.04	0.00
94	001328	C 登康	80	2,039.20	0.00
95	603172	C 万丰	122	1,967.86	0.00

96	001324	N 长青科	98	1,920.80	0.00
97	001360	C 南矿	114	1,695.18	0.00
98	603125	C 常青	64	1,569.92	0.00
99	001367	C 海森	37	1,460.76	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	600160	巨化股份	16,619,822.34	8.76
2	601233	桐昆股份	16,169,926.44	8.52
3	002567	唐人神	15,565,945.16	8.20
4	002100	天康生物	15,549,148.94	8.19
5	603379	三美股份	15,441,571.05	8.14
6	600975	新五丰	14,000,648.90	7.38
7	002493	荣盛石化	11,427,596.00	6.02
8	603225	新凤鸣	11,210,700.00	5.91
9	300498	温氏股份	8,351,619.00	4.40
10	002517	恺英网络	8,208,637.00	4.32
11	002463	沪电股份	7,944,314.00	4.19
12	603477	巨星农牧	7,857,894.00	4.14
13	603281	江瀚新材	7,395,289.49	3.90
14	002840	华统股份	6,467,090.80	3.41
15	600346	恒力石化	6,414,717.00	3.38
16	601318	中国平安	5,664,237.00	2.98
17	600958	东方证券	5,416,023.00	2.85
18	002601	龙佰集团	5,045,598.00	2.66
19	300533	冰川网络	4,664,143.00	2.46
20	000560	我爱我家	4,587,017.00	2.42
21	002555	三七互娱	4,024,401.00	2.12
22	002714	牧原股份	3,884,827.00	2.05
23	600011	华能国际	3,874,105.00	2.04
24	600027	华电国际	3,828,297.00	2.02
25	000831	中国稀土	3,819,502.00	2.01

注：买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603444	吉比特	13,108,774.00	6.91
2	600329	达仁堂	12,245,489.00	6.45
3	002555	三七互娱	12,226,724.00	6.44

4	300059	东方财富	11,966,016.40	6.30
5	002517	恺英网络	11,817,916.00	6.23
6	002714	牧原股份	11,332,245.60	5.97
7	002463	沪电股份	10,936,895.30	5.76
8	600958	东方证券	10,662,948.96	5.62
9	002304	洋河股份	8,706,496.00	4.59
10	601628	中国人寿	7,485,419.00	3.94
11	603281	江瀚新材	7,060,687.40	3.72
12	002027	分众传媒	6,918,700.00	3.64
13	300498	温氏股份	6,278,354.00	3.31
14	600346	恒力石化	6,197,368.00	3.26
15	603260	合盛硅业	5,942,490.00	3.13
16	002840	华统股份	5,849,569.00	3.08
17	603477	巨星农牧	5,706,263.00	3.01
18	300533	冰川网络	5,053,936.50	2.66
19	601318	中国平安	4,793,569.00	2.53
20	002601	龙佰集团	4,626,910.20	2.44
21	601233	桐昆股份	4,319,687.00	2.28
22	601390	中国中铁	4,109,460.00	2.16
23	603379	三美股份	4,076,960.63	2.15
24	600009	上海机场	4,074,918.00	2.15
25	000560	我爱我家	4,046,623.00	2.13
26	002049	紫光国微	3,934,102.00	2.07

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	255,475,273.29
卖出股票收入（成交）总额	245,971,288.90

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内，本基金投资的前十名股票中没有出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	71,753.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,188,311.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,260,064.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
472	324, 536. 55	147, 212, 121. 81	96. 1032	5, 969, 128. 51	3. 8968

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	1, 766, 120. 71	1. 1530

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2017 年 12 月 1 日) 基金份额总额	299, 416, 373. 03
本报告期期初基金份额总额	138, 687, 910. 25
本报告期基金总申购份额	14, 812, 108. 45
减：本报告期基金总赎回份额	318, 768. 38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	153, 181, 250. 32

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于 2023 年 6 月 17 日发布公告，自 2023 年 6 月 16 日起董晓亮先生不再担任

公司副总经理职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本公司及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
东北证券	2	165,305,667.42	33.23	69,645.78	22.34	-
国金证券	2	124,941,396.31	25.12	91,372.28	29.31	-
东吴证券	1	75,927,669.98	15.26	55,524.81	17.81	-
东兴证券	1	51,151,733.71	10.28	36,895.97	11.84	-
国泰君安证券	2	30,251,100.37	6.08	21,820.11	7.00	-
西部证券	1	27,861,320.58	5.60	20,375.68	6.54	-
东方证券	2	21,978,134.9	4.42	16,062.62	5.15	-

		6				
长江证券	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

- (1) 市场形象及财务状况良好。
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (3) 内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (4) 研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

根据上述标准进行考察后，由基金管理人的投资决策委员会确定租用券商的交易单元，并由基金管理人与被选择的券商签订协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本期无券商交易单元变更的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东北证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

注：本报告期基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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	太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
2	太平基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 8 日
3	太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
4	太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 20 日
5	太平改革红利精选灵活配置混合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	2023 年 4 月 20 日
6	太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金 2023 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
7	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 22 日
8	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加上海攀赢基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 31 日
9	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加上海挖财基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 5 月 31 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	20230101-20230630	100,002,750.00		-	100,002,750.00	65.2839
机构	2	20230101-20230630	32,881,099.57	-	-	32,881,099.57	21.4655

产品特有风险
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

注：报告期末同一投资者通过多个基金账户持有本基金的合并计算。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平改革红利精选灵活配置混合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）

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

2023 年 8 月 31 日