

太平福安稳健养老目标一年持有期混合型
基金中基金（FOF）
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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
§ 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	12
§ 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 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 本报告期投资基金情况	45
7.13 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	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	51
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.9 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）	
基金主代码	019676	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 11 月 14 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	
报告期末基金份额总额	262, 534, 829. 53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	太平福安稳健养老一年持有混合（FOF） A	太平福安稳健养老一年持有混合（FOF） Y
下属分级基金的交易代码	019676	020778
报告期末下属分级基金的份额总额	262, 511, 768. 17 份	23, 061. 36 份

注：1、本基金每份基金份额的最短持有期限为 1 年。

2、本基金于 2024 年 03 月 28 日公告增设 Y 类基金份额，代码为 020778

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的前提下，本基金优化配置各类资产，优选全市场各类基金，力争实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金的主要风险收益特征追求长期稳健，以配置非权益类资产为主，权益类资产为辅。对基金在投资周期内的资产配置进行布局。根据相应可投资资产的风险收益特征、估值盈利数据、市场容量及流动性，结合基金管理人的相关资产配置方法及模型，自上而下的评估其预期收益及风险情况。筛选出预计风险调整后收益较好的行业、板块，品种进行配置。亦会根据阶段性综合研判后的分析，进行调整。最终，获取组合层面的超额收益。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，由于本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。同时，本基金为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对稳健的基金。本基金可以投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		太平基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵霖	许俊
	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	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		焦艳军	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	2024 年 3 月 29 日（基金合同生效日） -2024 年 6 月 30 日
	太平福安稳健养老一年持有混合（FOF） A	太平福安稳健养老一年持有混合（FOF） Y
本期已实现收益	3,320,663.73	230.13
本期利润	1,685,460.85	-45.96
加权平均基金份 额本期利润	0.0068	-0.0022
本期加权平均净 值利润率	0.67%	-0.22%

本期基金份额净值增长率	0.80%	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	3,055,630.99	288.08
期末可供分配基金份额利润	0.0116	0.0125
期末基金资产净值	265,567,399.16	23,349.44
期末基金份额净值	1.0116	1.0125
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.16%	0.50%

注：1、本基金于2024年03月28日公告增设Y类基金份额，并于2024年03月29日开始办理申购等相关业务。

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

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）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
过去一个月	-1.24%	0.23%	-0.34%	0.11%	-0.90%	0.12%
过去三个月	0.03%	0.29%	0.21%	0.15%	-0.18%	0.14%
过去六个月	0.80%	0.24%	1.68%	0.20%	-0.88%	0.04%
自基金合同生效起	1.16%	0.22%	1.61%	0.19%	-0.45%	0.03%

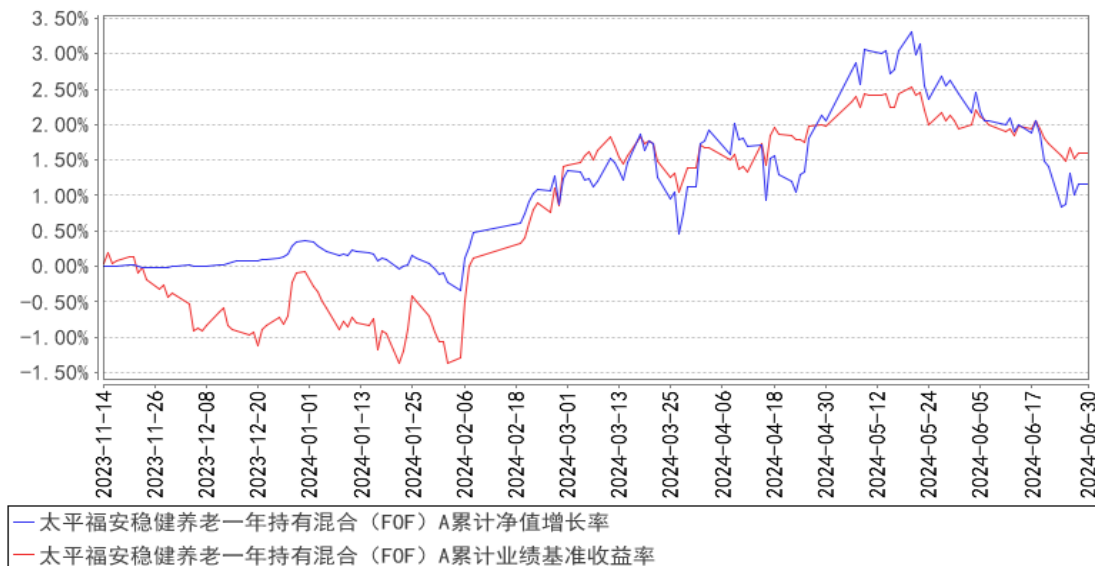
至今						
----	--	--	--	--	--	--

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）Y

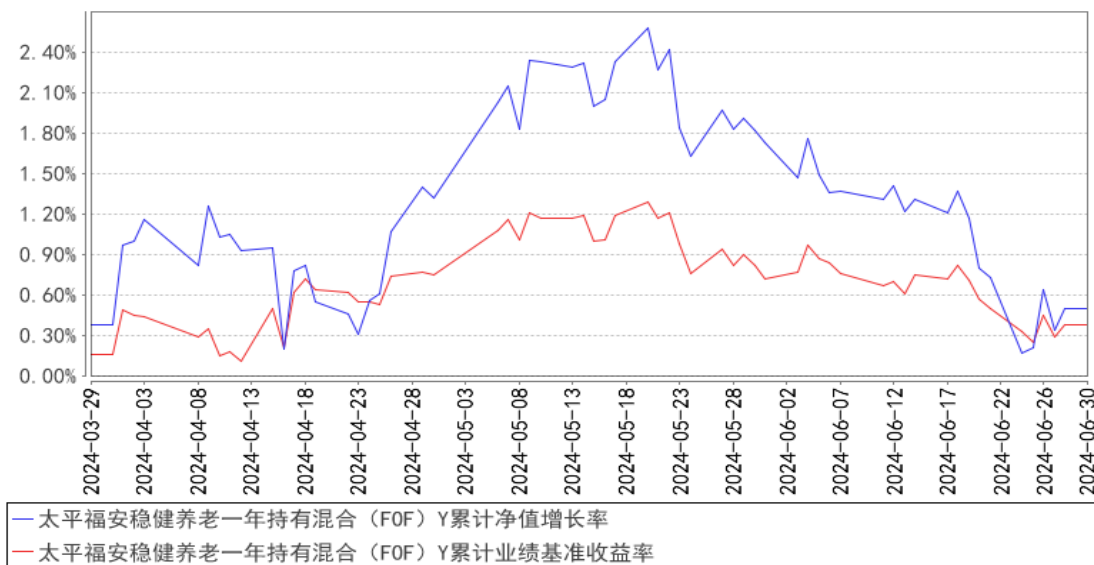
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.21%	0.23%	-0.34%	0.11%	-0.87%	0.12%
过去三个月	0.12%	0.29%	0.21%	0.15%	-0.09%	0.14%
自基金合同生效起至今	0.50%	0.29%	0.38%	0.15%	0.12%	0.14%

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

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）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



太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）Y 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期为 2023 年 11 月 14 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满足一年。本基金的建仓期为六个月，截至报告期末本基金已完成建仓，各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

自 2024 年 03 月 29 日起对本基金增加 Y 类基金份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 39 只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
刘翀	首席资产配置官兼多元资产投资部组合投资部总经理、本基金的基金经理	2023 年 11 月 14 日	-	16 年	上海财经大学经济学硕士，具有证券投资基金从业资格。2008 年 7 月起先后在光大证券股份有限公司、太平资产管理有限公司、华宝基金管理有限公司，富敦投资管理（上海）有限公司工作。2022 年 12 月加入太平基金管理有限公司，任首席资产配置官兼多元资产投资部组合投资部总经理。2023 年 11 月 14 日起担任太平福安稳健康养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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、证券投资基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资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遵规守信情况的说明

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

上半年，A 股市场呈现出较为反复的波动。大宗商品中的黄金逐级走高后，开始出现区间震荡的局面，但工业金属行业从年初上涨至 5 月下旬后，开始出现调整。美股纳斯达克指数在上半年走出了连续上涨的态势。

上半年，本基金秉承着建立安全垫后，逐渐增加权益类资产投资的策略。固定收益类资产保持中偏短的久期。对资源型及科技类行业 ETF 重点进行了投资。其中，也高度关注了并参与了港股类资产的投资。在下半年，全球利率进一步下行的前景下。所投资的行业具备一定的估值溢价的空间。

同时，我们也会对组合配置的策略，多市场资产配置收益风险特性进一步探究。致力于构建控制风险后，增厚组合收益的策略效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平福安稳健康养老一年持有混合（FOF）A 的份额净值增长率为 0.80%，同期业绩比较基准收益率为 1.68%；太平福安稳健康养老一年持有混合（FOF）Y 的份额净值增长率为 0.50%，同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国非制造业 PMI、非农就业和薪资增速及通胀等数据持续回落，美联储下半年降息是大概率事件；三中全会强调坚定不移完成今年经济增长目标，而上半年专项债发行速度和基建、社零增速都偏弱，下半年保增长政策出台和落地可能加速。

下半年 A 股处于盈利回升、信用回落的环境中，根据历史经验，盈利回升、信用回落时 A 股偏震荡；盈利继续回升但强度受限，流动性可能边际宽松，三中全会政策落地可能提振市场情绪，四季度面临盈利上行周期进入后期，三季度美联储可能降息、国内保增长政策可能加速。

一方面，在盈利上行、信用回落后筑底的阶段，中大盘风格占优，高景气和政策导向的行业占优；另一方面，根据历史经验，在盈利上行中后段周期、电子、养殖等盈利弹性较高。综合而言，下半年建议关注：一是盈利和景气向上且估值性价比较高的 TMT、电新、机械、汽车等；二是受益于经济修复、外资流入以及高股息相关的家电、银行、食品饮料、纺服等。

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”）在太平福安稳健康养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（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的真实、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：太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	11,921,748.33	259,259.77
结算备付金		678,823.94	219,009.92
存出保证金		36,370.25	14,393.16
交易性金融资产	6.4.7.2	255,096,957.89	232,676,917.13
其中：股票投资		-	-
基金投资		229,479,836.83	213,570,614.29
债券投资		25,617,121.06	19,106,302.84
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	9,700,000.00	3,499,694.13
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		-	728,537.09
应收股利		-	44,810.26
应收申购款		1.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		277,433,901.41	237,442,621.46
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		11,595,435.75	585,584.42
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		131,362.05	120,279.99
应付托管费		24,815.97	26,505.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,870.44	872.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	86,668.60	18,087.36
负债合计		11,843,152.81	751,330.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	262,534,829.53	235,846,273.40
未分配利润	6.4.7.11	3,055,919.07	845,018.02
净资产合计		265,590,748.60	236,691,291.42
负债和净资产总计		277,433,901.41	237,442,621.46

注：1、本基金合同生效日为2023年11月14日，本基金于2024年03月28日公告增设Y类基金份额，并于2024年03月29日开始办理申购等相关业务。本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。报告截止日2024年06月30日，基金份额总额262,534,829.53份，其中A类基金份额总额为262,511,768.17份，基金份额净值1.0116元；Y类基金份额总额为23,061.36份，基金份额净值1.0125元。

6.2 利润表

会计主体：太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2024年1月1日至2024年6月30日
一、营业总收入		2,663,134.96
1. 利息收入		22,563.33
其中：存款利息收入	6.4.7.12	6,050.78
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		16,512.55
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,276,050.60
其中：股票投资收益	6.4.7.13	-
基金投资收益	6.4.7.14	2,461,219.34
债券投资收益	6.4.7.15	420,838.26
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	1,393,993.00
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	-1,635,478.97
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	-
减：二、营业总支出		977,720.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	750,544.42
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	149,313.54
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-
7. 税金及附加		7,600.47
8. 其他费用	6.4.7.24	70,261.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,685,414.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,685,414.89
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,685,414.89

注：由于本基金于 2023 年 11 月 14 日成立，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	235,846,273.40	-	845,018.02	236,691,291.42
二、本期期初净资产	235,846,273.40	-	845,018.02	236,691,291.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	26,688,556.13	-	2,210,901.05	28,899,457.18
（一）、综合收益总额	-	-	1,685,414.89	1,685,414.89
（二）、本期基金份额交易产生的	26,688,556.13	-	525,486.16	27,214,042.29

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	26,688,556.13	-	525,486.16	27,214,042.29
2. 基金赎 回款	-	-	-	-
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	262,534,829.53	-	3,055,919.07	265,590,748.60

注：由于本基金于 2023 年 11 月 14 日成立，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至-财务报表由下列负责人签署：

曹琦

基金管理人负责人

邓先虎

主管会计工作负责人

王瑞瑾

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)(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[2023]2187号《关于准予太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)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《太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)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235,840,791.03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,《太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》于2023年11月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为235,846,273.40份,其中认购资金利息折合5,482.37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。

根据太平基金管理有限公司于2024年3月28日发布的《太平福安稳健养老目标一年持有

期混合型基金中基金（FOF）增加 Y 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》，自 2024 年 3 月 29 日起本基金增加 Y 类基金份额。

根据《太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》，本基金针对个人养老金投资基金业务设立单独的份额类别，从而将基金份额分为不同的类别。供投资人使用非个人养老金资金申购的一类基金份额，称为 A 类基金份额；针对个人养老金投资基金业务单独设立的一类基金份额，称为 Y 类基金份额，投资人可使用个人养老金资金购买本类别基金份额。本基金 A 类基金份额和 Y 类基金份额分别设置代码，合并投资运作，分别计算和公告各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、香港互认基金、商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF，下同）和公开募集基础设施证券投资基金等），股票（包括主板、创业板以及其他中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证），港股通标的股票，债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券），资产支持证券，债券回购，银行存款，同业存单，货币市场工具以及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：投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，其中本基金投资于股票，股票型基金，混合型基金和商品基金等品种的比例合计原则上不超过基金资产的 30%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，投资于商品基金的比例不超过基金资产的 10%，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%，投资于 QDII 基金和香港互认基金占基金资产的比例合计不超过 20%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和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。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资比例相应调整。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、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“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

（2）金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余

成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代

缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金分红或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不择，本基金 A 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红，本基金 Y 类基金份额默认的收益分配方式是红利再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券及可交换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券及可交换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(3) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的

基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	11,921,748.33
等于：本金	11,921,327.58
加：应计利息	420.75
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	11,921,748.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	26,308,640.65	150,487.06	25,617,121.06	-842,006.65
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	26,308,640.65	150,487.06	25,617,121.06	-842,006.65
资产支持证券		-	-	-	-
基金		231,033,701.27	-	229,479,836.83	-1,553,864.44
其他		-	-	-	-
合计		257,342,341.92	150,487.06	255,096,957.89	-2,395,871.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金于本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金于本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	9,700,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金于本报告期末未计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	66,667.80
预提审计费	20,000.80
合计	86,668.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）A

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	235,846,273.40	235,846,273.40
本期申购	26,665,494.77	26,665,494.77
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	262,511,768.17	262,511,768.17

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）Y

项目	本期 2024 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	23,061.36	23,061.36
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	23,061.36	23,061.36

注：1、本基金于 2024 年 03 月 28 日公告增设 Y 类基金份额，并于 2024 年 03 月 29 日开始办理申购等相关业务。

2、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

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,605,410.14	-760,392.12	845,018.02
本期期初	1,605,410.14	-760,392.12	845,018.02
本期利润	3,320,663.73	-1,635,202.88	1,685,460.85
本期基金份额交易产生的变动数	286,319.15	238,832.97	525,152.12
其中：基金申购款	286,319.15	238,832.97	525,152.12
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,212,393.02	-2,156,762.03	3,055,630.99

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期期初	-	-	-
本期利润	230.13	-276.09	-45.96
本期基金份额交易产生的变动数	247.70	86.34	334.04
其中：基金申购款	247.70	86.34	334.04
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	477.83	-189.75	288.08

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	2,522.31	
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	3,329.26	
其他	199.21	
合计	6,050.78	

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

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益买卖股票差价收入。

6.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.14 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
卖出/赎回基金成交总额	361,309,971.11	
减：卖出/赎回基金成本总额	358,769,989.39	
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	62,148.92	
减：交易费用	16,613.46	
基金投资收益	2,461,219.34	

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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	169,969.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	250,868.33
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	420,838.26

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	62,642,070.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	62,043,699.45
减：应计利息总额	343,336.38
减：交易费用	4,166.34
买卖债券差价收入	250,868.33

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	1,393,993.00
合计	1,393,993.00

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,635,478.97
股票投资	-
债券投资	-848,069.75
资产支持证券投资	-
基金投资	-787,409.22
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	-1,635,478.97

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.22 持有基金产生的费用

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	46,510.00
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	512,073.26
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	138,045.44

注：当期持有基金产生的应付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值上，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.4.7.23 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	15,826.72
信息披露费	52,754.52
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,680.40
合计	70,261.64

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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
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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的基金交易

6.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	750,544.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	80,327.50
应支付基金管理人的净管理费	670,216.92

注：太平福安稳健康养老一年持有混合（FOF）A 支付基金管理人太平基金的管理人报酬按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）的 0.6% 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（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分） × 0.6% / 当年天数。

太平福安稳健康养老一年持有混合（FOF）Y 支付基金管理人太平基金的管理人报酬按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）的 0.3% 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（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分） × 0.3% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	149,313.54

注：太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）A 支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金部分）的 0.15%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（扣除投资于本基金托管人所托管的基金部分）×0.15%/当年天数。

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）Y 支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金部分）的 0.075%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（扣除投资于本基金托管人所托管的基金部分）×0.075%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

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

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）A

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
太平人寿	99,999,972.22	38.0935	99,999,972.22	42.4005

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	11,921,748.33	2,522.31

注：1、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。

2、由于本基金于 2023 年 11 月 14 日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未投资基金管理人以及管理人关联方所管理基金。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-
太平福安稳健养老一年持有混合（FOF）Y								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金中基金，由于本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金的预期风险与预期收益高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。同时，本基金为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对稳健的基金。

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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	14,954,035.35	10,097,150.68
合计	14,954,035.35	10,097,150.68

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、短期未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	584,506.72
AAA 以下	10,663,085.71	5,389,401.60
未评级	-	3,035,243.84
合计	10,663,085.71	9,009,152.16

注：

1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债。

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有单只基金的市值，不高于本基金资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF 联接基金除外)不超过被投资基金净资产的 20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)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，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，其余亦可在基金销售机构申购、赎回，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公

允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于本年度末，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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,921,748.33	-	-	-	11,921,748.33
结算备付金	678,823.94	-	-	-	678,823.94

存出保证金	36,370.25	-	-	-	36,370.25
交易性金融资产	15,601,072.06	10,016,049.00	-	-229,479,836.83	255,096,957.89
买入返售金融资产	9,700,000.00	-	-	-	9,700,000.00
应收申购款	-	-	-	1.00	1.00
资产总计	37,938,014.58	10,016,049.00	-	-229,479,837.83	277,433,901.41
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	131,362.05	131,362.05
应付托管费	-	-	-	24,815.97	24,815.97
应付清算款	-	-	-	11,595,435.75	11,595,435.75
应交税费	-	-	-	4,870.44	4,870.44
其他负债	-	-	-	86,668.60	86,668.60
负债总计	-	-	-	11,843,152.81	11,843,152.81
利率敏感度缺口	37,938,014.58	10,016,049.00	-	-217,636,685.02	265,590,748.60
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	259,259.77	-	-	-	259,259.77
结算备付金	219,009.92	-	-	-	219,009.92
存出保证金	14,393.16	-	-	-	14,393.16
交易性金融资产	14,892,239.61	4,214,063.23	-	-213,570,614.29	232,676,917.13
买入返售金融资产	3,499,694.13	-	-	-	3,499,694.13
应收股利	-	-	-	44,810.26	44,810.26
应收清算款	-	-	-	728,537.09	728,537.09
资产总计	18,884,596.59	4,214,063.23	-	-214,343,961.64	237,442,621.46
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	120,279.99	120,279.99
应付托管费	-	-	-	26,505.36	26,505.36
应付清算款	-	-	-	585,584.42	585,584.42
应交税费	-	-	-	872.91	872.91
其他负债	-	-	-	18,087.36	18,087.36
负债总计	-	-	-	751,330.04	751,330.04
利率敏感度缺口	18,884,596.59	4,214,063.23	-	-213,592,631.60	236,691,291.42

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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金净资产的比例为 9.65%（2023 年 12 月 31 日：8.07%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2023 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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、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，在战略资产配置层面，将结合内外部投资研究经验，对各大类资产的投资回报进行展望，形成基金在各类资产的中长期配置中枢。在宏观基本面分析上将综合宏观、估值、情绪、政策等构建战术资产分配框架，对处于上升通道的强势资产，或短期趋势有大概率由弱转强的资产，将给予适当的超配；对处于下行通道的弱势资产，或短期趋势有大概率由强转弱的资产，将给予适当的低配。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金 80%以上基金资产投资于其他经中国证监会依法核准或注册的公开募集基金份额，其中权益类资产的比例为 10%-25%；现金或到期日在一年内的政府债券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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	229,479,836.83	86.40	213,570,614.29	90.23
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	229,479,836.83	86.40	213,570,614.29	90.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设业绩比较基准变化 5%，其他变量不变。		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	9,685,369.50	6,230.35
业绩比较基准下降 5%	-9,685,369.50	-6,230.35	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	240,142,922.54	219,544,522.61
第二层次	14,954,035.35	13,132,394.52
第三层次	-	-
合计	255,096,957.89	232,676,917.13

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未持有第三层次公允价值资产。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	229,479,836.83	82.72
3	固定收益投资	25,617,121.06	9.23
	其中：债券	25,617,121.06	9.23
	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	9,700,000.00	3.50
	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	12,600,572.27	4.54
8	其他各项资产	36,371.25	0.01
9	合计	277,433,901.41	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

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	14,954,035.35	5.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,663,085.71	4.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,617,121.06	9.65

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	019733	24 国债 02	95,000	9,601,941.51	3.62
2	019740	24 国债 09	30,000	3,010,255.89	1.13
3	019727	23 国债 24	23,000	2,341,837.95	0.88
4	111007	永和转债	19,000	2,206,056.16	0.83
5	123168	惠云转债	16,000	1,694,069.04	0.64

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

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

按照基金合同约定的投资范围，本基金不投资国债期货。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	511990	华宝添益ETF	交易型开放式(ETF)	150,376.00	15,038,953.38	5.66	否
2	070025	嘉实信用债券A	契约型开放式	9,923,679.45	12,948,416.95	4.88	否
3	000753	华宝量化对冲策略混合A	契约型开放式	10,312,779.44	12,099,984.12	4.56	否
4	005159	华泰保兴尊合债券A	契约型开放式	9,512,785.38	11,252,673.83	4.24	否

5	162210	宏利集利债券 A	契约型开放式	8,238,259.16	10,745,985.25	4.05	否
6	001338	安信稳健增值灵活配置混合 C	契约型开放式	6,580,041.07	10,726,782.95	4.04	否
7	002245	泰康稳健增利债券 A	契约型开放式	7,357,736.74	10,288,323.28	3.87	否
8	121012	国投瑞银优化增强债券 A/B	契约型开放式	7,952,911.57	10,179,726.81	3.83	否
9	005079	兴银鑫日享短债债券 A	契约型开放式	9,071,856.29	10,145,964.07	3.82	否
10	005725	国投瑞银恒泽中短债债券 A	契约型开放式	9,068,878.98	10,030,180.15	3.78	否
11	851830	海通安裕中短债债券 A	契约型开放式	8,861,219.43	10,007,861.22	3.77	否
12	420102	天弘永利债券 B	契约型开放式	7,809,504.80	9,367,501.01	3.53	否
13	004427	交银施罗德增利增强债券 A	契约型开放式	7,794,617.44	9,358,217.70	3.52	否
14	511880	银华日利交易货币 A	交易型开放式 (ETF)	82,000.00	8,276,506.00	3.12	否
15	512580	广发中证环保产业 ETF	交易型开放式 (ETF)	8,188,000.00	7,098,996.00	2.67	否
16	008817	华宝可转债	契约	4,858,543.46	6,931,683.95	2.61	否

		债券 C	型开 放式				
17	516970	广发中证基建工程 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	6,500,000.00	6,675,500.00	2.51	否
18	007574	宝盈新价值灵活配置混合 C	契约 型开 放式	2,296,280.67	6,617,880.89	2.49	否
19	470058	汇添富可转换债券 A	契约 型开 放式	3,556,737.25	6,337,750.11	2.39	否
20	588000	华夏上证科创板 50 成份 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	7,000,000.00	5,215,000.00	1.96	否
21	006545	兴银中短债债券 A	契约 型开 放式	4,142,998.52	5,020,899.91	1.89	否
22	002796	景顺长城景盈双利债券 A	契约 型开 放式	4,310,630.22	4,990,416.61	1.88	否
23	040023	华安可转换债券债券 B	契约 型开 放式	2,871,422.31	4,818,246.64	1.81	否
24	159980	有色 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	2,600,000.00	4,524,000.00	1.70	否
25	515100	景顺长城中证红利低波动 100ETF	交易 型开 放式 (ETF)	3,000,000.00	3,984,000.00	1.50	否
26	516780	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF	交易 型开 放式	4,229,600.00	3,425,976.00	1.29	否

			(ETF)				
27	513180	华夏恒生科技 ETF(QDII)	交易型开放式(ETF)	7,000,000.00	3,423,000.00	1.29	否
28	159745	国泰中证全指建筑材料 ETF	交易型开放式(ETF)	4,500,000.00	2,389,500.00	0.90	否
29	515120	广发中证创新药产业 ETF	交易型开放式(ETF)	4,300,000.00	1,960,800.00	0.74	否
30	510900	易方达恒生中国企业(QDII-ETF)	交易型开放式(ETF)	1,800,000.00	1,470,600.00	0.55	否
31	511380	博时中证可转债及可交换债券 ETF	交易型开放式(ETF)	130,000.00	1,427,010.00	0.54	否
32	159870	化工 ETF	交易型开放式(ETF)	2,500,000.00	1,417,500.00	0.53	否
33	159850	恒生国企 ETF	交易型开放式(ETF)	2,000,000.00	1,284,000.00	0.48	否

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	36,370.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,371.25

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111007	永和转债	2,206,056.16	0.83
2	123168	惠云转债	1,694,069.04	0.64
3	123169	正海转债	1,582,626.12	0.60
4	127090	兴瑞转债	1,374,563.68	0.52
5	127064	杭氧转债	1,230,465.48	0.46
6	118038	金宏转债	1,161,021.88	0.44
7	110090	爱迪转债	767,246.64	0.29
8	128130	景兴转债	647,036.71	0.24

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.6 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 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
太平福安 稳健养老 一年持有 混合 (FOF) A	8,983	29,223.17	217,472,385.59	82.8429	45,039,382.58	17.1571
太平福安 稳健养老 一年持有 混合 (FOF) Y	6	3,843.56	-	0.0000	23,061.36	100.0000
合计	8,986	29,215.98	217,472,385.59	82.8356	45,062,443.94	17.1644

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 理人所有从业 人员持 有本基 金	太平福安稳健养老一年持有混 合（FOF）A	375,866.64	0.1432
	太平福安稳健养老一年持有混 合（FOF）Y	20,723.33	89.8617
	合计	396,589.97	0.1511

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、 基金投资和部门 负责人持有本开放式 基金	太平福安稳健养老一年持有 混合（FOF）A	10~50
	太平福安稳健养老一年持有 混合（FOF）Y	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有 本开放式基金	太平福安稳健养老一年持有 混合（FOF）A	0~10
	太平福安稳健养老一年持有 混合（FOF）Y	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	太平福安稳健养老一年持有混合	太平福安稳健养老一年持有混合
----	----------------	----------------

	(FOF) A	(FOF) Y
基金合同生效日 (2023 年 11 月 14 日) 基金份额总额	235,846,273.40	-
本报告期期初基金份 额总额	235,846,273.40	-
本报告期基金总申购 份额	26,665,494.77	23,061.36
减: 本报告期基金总 赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	262,511,768.17	23,061.36

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）自 2023 年 11 月 14 日（基金合同生效日）起

至今为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本公司及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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 (%)	
兴业证券	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) 公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定。最近一年未出现亏损或审计机构无法出具无保留意见的审计报告等情形；

(2) 经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到监管部门处罚；

(3) 合规风控能力较强。内部管理规范、严格，具备健全的内控和风险控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。最近一年证监会对证券公司分类结果为 BB 类以上（含）；

(4) 交易服务能力较强。具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需。重点参考最近一个年度券商交易量市场排名；

(5) 研究服务能力较强。设置固定的研究机构，拥有专业的研究人员，能够及时全面地提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他信息服务等。

(6) 与公司签订综合服务协议。

基金管理人的总经理办公会根据上述标准确定可以合作的券商名单，由投资决策委员会在上述名单内确定租用的交易单元，并签订交易单元租用协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本报告期内，本基金无新增租用交易单元的情况。

10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
兴业证券	131,959,577.89	100.00	201,100,000.00	100.00	-	-	337,963,169.16	100.00

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 16 日
2	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）风险揭示书	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 28 日
3	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）增加 Y 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 28 日
4	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 28 日
5	关于太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）Y 类份额开放日常申购、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 28 日
6	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 28 日
7	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 28 日

8	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年3月28日
9	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)（Y类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年3月28日
10	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（Y类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年4月20日
11	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年4月20日
12	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)招募说明书（更新）（2024年第2号）	中国证监会规定媒介	2024年4月20日
13	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）2024年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2024年4月22日
14	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加中国银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2024年4月29日
15	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)（Y类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年6月28日
16	太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024年6月28日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101 - 20240630	99,999,972.22	-	-	99,999,972.22	38.0902
机构	2	20240101 - 20240324	50,001,430.55	-	-	50,001,430.55	19.0456
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、《太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》
- 3、《太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》
- 4、《太平福安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼, 503A）

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司