

太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券  
投资基金  
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：中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信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 06 月 30 日。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	11
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	12
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
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	45
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	46
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	46
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	46

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 .....	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.11 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
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 .....	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	太平丰泰一年定开债券发起式
基金主代码	012140
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 24 日
基金管理人	太平基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,909,998,024.75 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求资产长期稳健增值的基础上，力争为份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产、权益类资产、现金类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，以规避市场风险，提高基金收益率。</p> <p><b>（一）封闭期投资策略</b></p> <p>本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、资产支持证券投资策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。</p> <p><b>1、久期策略</b></p> <p>本基金将基于对宏观经济政策的分析，积极的预测未来利率变化趋势，并根据预测确定相应的久期目标，调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时，本基金将适当降低组合久期；而预期市场利率将下降时，则适当提高组合久期。在确定债券组合久期的过程中，本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。</p> <p><b>2、收益率曲线策略</b></p> <p>在组合的久期配置确定以后，本基金将通过收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。</p> <p><b>3、类属配置策略</b></p> <p>本基金对不同类型债券的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场</p>

风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

#### 4、利率品种策略

本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

#### 5、信用债策略

本基金所指信用债包括：金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债和中期票据等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用担保的固定收益类金融工具。

本基金不得投资于信用评级低于 AA+ 的信用债，其中投资于 AA+ 评级信用债的比例不超过信用债资产总值的 50%，投资于 AAA 评级信用债的比例占信用债资产总值的 50%-100%。

金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、资产支持证券、次级债和中期票据等信用债的信用评级依照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级；短期融资券和超短期融资券等信用债的信用评级依照基金管理人选定评级机构出具的主体信用评级。

本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值 and 风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### 7、国债期货投资策略

基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，谨慎进行对国债期货的投资。

#### 8、杠杆投资策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

#### 9、可转换债券投资策略

本基金持有全部可转债总市值不超过基金资产净值的 20%。基金管理人着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究，同时兼顾其

	<p>债券价值和转换期权价值，对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。本基金管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等，并参考同类公司的估值水平，研判发行公司的投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。</p> <p>10、股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资策略以精选个股为主，发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，从定量和定性两个方面考察国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地上市公司的增值潜力。定量方面综合考虑盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，包括净资产与市值比率(B/P)、每股盈利/每股市价(E/P)、年现金流/市值(cashflow-to-price)和销售收入/市值(S/P)等价值指标以及净资产收益率(ROE)、每股收益增长率和主营业务收入增长率等成长指标。定性方面考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势等多种因素，精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。</p> <p>本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>在开放期，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化，基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金可能投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	太平基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵霖
	联系电话	021-38556613
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn
滕菲菲	4006800000	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话	021-61560999/400-028-8699	95558
传真	021-38556677	010-85230024
注册地址	上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	200120	100020

法定代表人	焦艳军	方合英
-------	-----	-----

## 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	62,031,684.94
本期利润	100,731,620.55
加权平均基金份额本期利润	0.0346
本期加权平均净值利润率	3.39%
本期基金份额净值增长率	3.44%
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	86,893,283.80
期末可供分配基金份额利润	0.0299
期末基金资产净值	3,026,416,077.35
期末基金份额净值	1.0400
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	5.54%

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

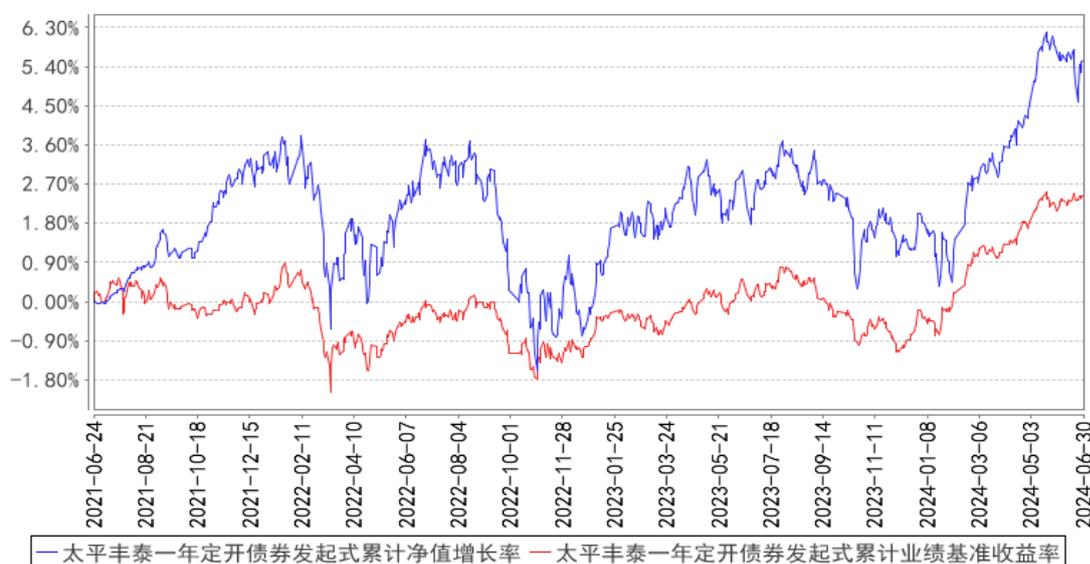
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.18%	0.24%	0.33%	0.07%	-0.51%	0.17%
过去三个月	2.25%	0.20%	1.26%	0.09%	0.99%	0.11%
过去六个月	3.44%	0.21%	2.61%	0.10%	0.83%	0.11%
过去一年	3.05%	0.20%	2.21%	0.10%	0.84%	0.10%
过去三年	5.58%	0.23%	2.24%	0.12%	3.34%	0.11%
自基金合同生效起至今	5.54%	0.23%	2.41%	0.12%	3.13%	0.11%

### 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

太平丰泰一年定开债券发起式累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 6 月 24 日，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规

范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 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		
吴超	固定收益投资部助理总监、本基金的基金经理	2021年6月24日	-	11年	美国本特利商学院金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013年5月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公司担任部门经理、投资总监等职。2017年3月加入本公司，现任固定收益投资部助理总监。2018年2月12日至2022年8月15日任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2019年3月25日起任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2019年6月27日起任太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020年5月28日起任太平中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。2020年8月7日起任太平恒泽63个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020年11月12日起任太平恒久纯债债券型证券投资基金基金经理。2021年6月24日起任太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021年9月17日起任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。
苏大明	本基金的基金经理助理	2021年9月24日	2024年1月10日	11年	上海交通大学工程硕士，具有证券投资基金从业资格。2017年4月起在光大证券股份有限公司研究所从事研究分析工作。2020年3月加入本公司。2024年1月11日起担任太平睿安混合型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期一般情况下根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；

若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

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

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年我国经济数据延续复苏趋势，高质量发展扎实推进。一季度经济开门红，二季度略有放缓。上半年工业增加值表现较好，高于过去三年均值，但价格指数仍在收缩。

股票市场先扬后抑，春节后市场情绪明显好转，上证指数创出年内新高，但市场在 5 月开始回落，市场预期再度偏弱。风格上以红利价值较为强势，其他成长风格轮动较多。

债券市场上半年表现继续强劲，长端收益率下行明显，虽然期间央行提示超长端久期风险，债市出现回调，但市场做多情绪仍然较强，30 年国债收益率创出近几年新低。

本报告期内，本基金保持相对较低的权益仓位，风格相对偏向价值，二季度加仓转债以偏债性转债为主；纯债方面以中短久期信用债套息策略为主。

### 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 3.44%，同期业绩比较基准为 2.61%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们判断宏观经济大概率仍将延续弱复苏态势，复苏动力仍不宜高估。

从经济各分项来看：1、出口回暖趋势或将延续，但下半年海外不确定性因素较多；2、消费对经济回暖有支撑，但收入和风险偏好压制下同比增幅不会太快；3、地产链条对于经济的拖累仍在，需要进一步观察政策效果；4、政策支持下的基建和制造业投资仍将为基本面的重要支撑。

债券市场仍未出现明显拐点，但估值愈发极致下市场波动或将加剧，应密切关注可能导致情绪变动的风险因素。

股票市场预计仍机会与风险并存，结构性行情概率较大。持续关注低利率环境下红利板块的长期配置价值，以及美联储降息后带来的外资回流机会。

#### 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金

2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，太平基金管理有限公司在太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，太平基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	13,531,102.73	8,035,485.58
结算备付金		19,166,640.41	15,282,373.89
存出保证金		269,267.50	279,005.17
交易性金融资产	6.4.7.2	4,252,384,744.72	5,110,082,285.43
其中：股票投资		345,554,581.83	445,520,003.26
基金投资		-	-
债券投资		3,783,966,108.10	4,594,140,515.59
资产支持证券投资		122,864,054.79	70,421,766.58
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	-	3,300,922.20
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		88,493,256.59	63,561,852.17
应收股利		2,728,750.95	94,045.13
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,376,573,762.90	5,200,635,969.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,283,845,993.69	2,212,105,622.38
应付清算款		64,669,809.61	60,995,543.84
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		867,996.56	864,216.80
应付托管费		198,399.21	197,535.25
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		98,362.68	77,194.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	477,123.80	711,399.97
负债合计		1,350,157,685.55	2,274,951,512.77
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,909,998,024.75	2,909,998,024.75
未分配利润	6.4.7.11	116,418,052.60	15,686,432.05
净资产合计		3,026,416,077.35	2,925,684,456.80
负债和净资产总计		4,376,573,762.90	5,200,635,969.57

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0400 元，基金份额总额 2,909,998,024.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日

<b>一、营业总收入</b>		122,230,424.17	98,874,701.92
1. 利息收入		534,357.39	563,686.40
其中：存款利息收入	6.4.7.12	227,846.90	263,162.84
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		306,510.49	300,523.56
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		82,996,131.17	23,817,374.94
其中：股票投资收益	6.4.7.13	678,787.87	-42,996,485.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	76,629,216.94	59,496,490.06
资产支持证券投资	6.4.7.15	1,328,203.73	1,416,054.17
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	54,830.22
股利收益	6.4.7.18	4,359,922.63	5,846,486.02
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	38,699,935.61	74,493,640.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		21,498,803.62	25,757,064.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,165,915.77	5,077,793.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,180,780.79	1,160,638.60
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		14,969,442.45	19,374,517.72
其中：卖出回购金融资产支出		14,969,442.45	19,374,517.72
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		71,737.79	32,625.73
8. 其他费用	6.4.7.22	110,926.82	111,488.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		100,731,620.55	73,117,637.49
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		100,731,620.55	73,117,637.49
<b>五、其他综合收益的税后</b>		-	-

净额			
六、综合收益总额		100,731,620.55	73,117,637.49

### 6.3 净资产变动表

会计主体：太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金

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	2,909,998,024. 75	-	15,686,432.05	2,925,684,456.8 0
二、本期期初净资产	2,909,998,024. 75	-	15,686,432.05	2,925,684,456.8 0
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	100,731,620.55	100,731,620.55
(一)、综合收益总额	-	-	100,731,620.55	100,731,620.55
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
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	2,909,998,024. 75	-	116,418,052.60	3,026,416,077.3 5
项目	上年度可比期间 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	2,909,998,000.	-	-46,276,426.44	2,863,721,573.5

	00			6
二、本期期初净资产	2,909,998,000.00	-	-46,276,426.44	2,863,721,573.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	73,117,637.49	73,117,637.49
(一)、综合收益总额	-	-	73,117,637.49	73,117,637.49
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
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	2,909,998,000.00	-	26,841,211.05	2,936,839,211.05

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：

曹琦

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

太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]942 号《关于准予太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由太平基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,909,998,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。经向中国证监会备案，《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,909,998,000.00 份，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、资产支持证券、银行存款、国债期货、同业存单、债券回购等金融工具，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；港股通标的股票的投资比例不超过基金股票资产的 50%；开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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

本基金财务报表符合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》及附

注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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

本基金在本报告期内未发生会计估计变更。

##### 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	13,531,102.73
等于：本金	13,530,043.56
加：应计利息	1,059.17
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	13,531,102.73

#### 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	345,642,229.80	-	345,554,581.83	-87,647.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,061,196,991.49	20,555,988.32	2,087,279,669.29	5,526,689.48
	银行间市场	1,653,402,365.45	18,913,438.81	1,696,686,438.81	24,370,634.55
	合计	3,714,599,356.94	39,469,427.13	3,783,966,108.10	29,897,324.03
资产支持证券	121,244,907.40	1,904,054.79	122,864,054.79	-284,907.40	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,181,486,494.14	41,373,481.92	4,252,384,744.72	29,524,768.66	

#### 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

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金于本报告期末未计提减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	395,074.56
其中：交易所市场	366,988.45
银行间市场	28,086.11
应付利息	-
预提审计费	22,376.90
预提信息披露费	59,672.34
合计	477,123.80

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

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	2,909,998,024.75	2,909,998,024.75
本期申购	-	-
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	2,909,998,024.75	2,909,998,024.75

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,861,598.86	-9,175,166.81	15,686,432.05
本期期初	24,861,598.86	-9,175,166.81	15,686,432.05
本期利润	62,031,684.94	38,699,935.61	100,731,620.55
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-

本期末	86,893,283.80	29,524,768.80	116,418,052.60
-----	---------------	---------------	----------------

#### 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	30,977.01	
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	191,547.36	
其他	5,322.53	
合计	227,846.90	

#### 6.4.7.13 股票投资收益

##### 6.4.7.13.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	678,787.87	
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	678,787.87	

##### 6.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	551,971,748.29	
减：卖出股票成本总额	549,956,425.14	
减：交易费用	1,336,535.28	
买卖股票差价收入	678,787.87	

##### 6.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入	56,233,300.98	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	20,395,915.96	

券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	76,629,216.94

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	2,848,947,737.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,787,102,015.02
减：应计利息总额	41,393,934.77
减：交易费用	55,872.22
买卖债券差价收入	20,395,915.96

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无债券投资收益—赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无债券投资收益—申购差价收入。

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	1,328,203.73
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,328,203.73

##### 6.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益—申购差价收入。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

##### 6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益—赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无贵金属投资收益—申购差价收入。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

##### 6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期无衍生工具收益—其他投资收益。

#### 6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,359,922.63
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	4,359,922.63

#### 6.4.7.19 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	38,699,935.61
股票投资	14,943,752.53
债券投资	23,773,942.53
资产支持证券投资	-17,759.45
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	38,699,935.61

#### 6.4.7.20 其他收入

本基金在本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.21 信用减值损失

本基金于本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	10,177.58
账户维护费	18,600.00
其他	100.00
合计	110,926.82

#### 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

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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人
太平人寿保险有限公司（“太平人寿”）	基金管理人的股东

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均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均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均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 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 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均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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,165,915.77	5,077,793.96
其中：应支付销售机构的客户维护 费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	5,165,915.77	5,077,793.96

注：支付基金管理人太平基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,180,780.79	1,160,638.60

注：支付基金托管行中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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。

#### 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均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。

### 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
基金合同生效日(2021年6月24日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3436%	0.3436%

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

#### 6.4.10.5.2 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		上年度末	
	2024年6月30日		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	2,899,998,000.00	99.6564	2,899,998,000.00	99.6564
------	------------------	---------	------------------	---------

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		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中信银行	13,531,102.73	30,977.01	5,930,475.70	29,443.59

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 530,221,915.17 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012384023	23 国联 SCP024	2024 年 7 月 3 日	101.73	300,000	30,519,770.49
09230407	23 农发清发 07	2024 年 7 月 3 日	104.87	300,000	31,460,311.48
09240201	24 国开清发 01	2024 年 7 月 3 日	103.95	250,000	25,987,130.14
102100492	21 科学城 MTN001	2024 年 7 月 3 日	104.82	500,000	52,410,082.19

102100898	21 华发集团 MTN005	2024 年 7 月 3 日	101.43	200,000	20,286,916.16
102381617	23 杭州国资 MTN001	2024 年 7 月 3 日	103.98	700,000	72,788,295.08
102480253	24 诚通控股 MTN003B	2024 年 7 月 3 日	112.23	200,000	22,446,115.85
102480424	24 诚通控股 MTN005B	2024 年 7 月 3 日	109.02	300,000	32,706,314.75
102481538	24 华发集团 MTN008	2024 年 7 月 3 日	101.59	300,000	30,476,547.95
1905343	19 宁夏债 31	2024 年 7 月 3 日	127.84	200,000	25,568,266.30
2020022	20 南京银行二级 01	2024 年 7 月 3 日	101.73	1,075,000	109,365,092.60
2028034	20 浦发银行二级 03	2024 年 7 月 3 日	106.01	260,000	27,562,080.00
210210	21 国开 10	2024 年 7 月 3 日	107.93	300,000	32,380,265.75
212400006	24 北京农商行债 01	2024 年 7 月 3 日	100.00	248,000	24,800,156.27
212480016	24 杭州联合农商小微债 01	2024 年 7 月 3 日	100.06	100,000	10,005,646.58
220215	22 国开 15	2024 年 7 月 3 日	107.77	200,000	21,554,502.73
2371248	23 辽宁债 48	2024 年 7 月 3 日	105.05	300,000	31,515,868.85
合计				5,733,000	601,833,363.17

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 753,624,078.52 元, 截至 2024 年 12 月 13 日(先后)到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

#### 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

本基金为债券型基金, 预期收益和预期风险高于货币市场基金, 但低于混合型基金、股票型基金, 属于证券投资基金中较低预期风险/收益的产品。本基金投资的金融工具主要包括具有良好流动性的固定收益类品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括

信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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	91,439,245.90	171,207,453.55
合计	91,439,245.90	171,207,453.55

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、短期未评级债券为短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

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	-	176,465,626.04
合计	-	176,465,626.04

#### 6.4.13.2.3 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	2,598,279,013.13	3,349,487,044.14
AAA 以下	468,367,521.76	142,950,376.54
未评级	625,880,327.31	754,030,015.32
合计	3,692,526,862.20	4,246,467,436.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、长期未评级债券为国债、政策性金融债、中期票据、公司债。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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	122,864,054.79	70,421,766.58
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	122,864,054.79	70,421,766.58

#### 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约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 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上市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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；

并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结算备用金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	13,531,102.73	-	-	-	13,531,102.73
结算备付金	19,166,640.41	-	-	-	19,166,640.41
存出保证金	269,267.50	-	-	-	269,267.50
交易性金融资产	1,198,902,432.45	1,818,417,690.49	889,510,039.95	345,554,581.83	4,252,384,744.72
应收股利	-	-	-	2,728,750.95	2,728,750.95
应收清算款	-	-	-	88,493,256.59	88,493,256.59
资产总计	1,231,869,443.09	1,818,417,690.49	889,510,039.95	436,776,589.37	4,376,573,762.90
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	867,996.56	867,996.56
应付托管费	-	-	-	198,399.21	198,399.21
应付清算款	-	-	-	64,669,809.61	64,669,809.61
卖出回购金融资产款	1,283,845,993.69	-	-	-	1,283,845,993.69
应交税费	-	-	-	98,362.68	98,362.68
其他负债	-	-	-	477,123.80	477,123.80
负债总计	1,283,845,993.69	-	-	66,311,691.86	1,350,157,685.55
利率敏感度缺口	-51,976,550.60	1,818,417,690.49	889,510,039.95	370,464,897.51	3,026,416,077.35
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	8,035,485.58	-	-	-	8,035,485.58
结算备付金	15,282,373.89	-	-	-	15,282,373.89
存出保证金	279,005.17	-	-	-	279,005.17
交易性金融资产	1,273,835,424.29	3,304,513,177.78	86,213,680.10	445,520,003.26	5,110,082,285.43
买入返售金融资产	3,300,922.20	-	-	-	3,300,922.20
应收股利	-	-	-	94,045.13	94,045.13
应收清算款	-	-	-	63,561,852.17	63,561,852.17
资产总计	1,300,733,211.13	3,304,513,177.78	86,213,680.10	509,175,900.56	5,200,635,969.57
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	864,216.80	864,216.80
应付托管费	-	-	-	197,535.25	197,535.25
应付清算款	-	-	-	60,995,543.84	60,995,543.84
卖出回购金融资产款	2,212,105,622.38	-	-	-	2,212,105,622.38
应交税费	-	-	-	77,194.53	77,194.53
其他负债	-	-	-	711,399.97	711,399.97
负债总计	2,212,105,622.38	-	-	62,845,890.39	2,274,951,512.77
利率敏感度缺口	-911,372,411.25	3,304,513,177.78	86,213,680.10	446,330,010.17	2,925,684,456.80

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	33,194,647.52	36,014,344.28
	2. 市场利率上升 25 个基点	-32,609,704.54	-35,434,763.40

#### 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。本基金本期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	206,438,549.93	-	206,438,549.93
资产合计	-	206,438,549.93	-	206,438,549.93
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	206,438,549.93	-	206,438,549.93

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量不变		
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 )
	所有外币相对人民币升值 5%	-	10,321,927.50
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-10,321,927.50

#### 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。本基金投资组合中债券投资比例不低于基金总资产的 80%，港股通标的股票的投资比例不超过基金股票资产的 50%。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 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	345,554,581.83	11.42	445,520,003.26	15.23
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	345,554,581.83	11.42	445,520,003.26	15.23

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 11.42%(2023 年 12 月 31 日：15.23%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	947,003,777.13	783,495,013.47
第二层次	3,305,380,967.59	4,326,587,271.96
第三层次	-	-
合计	4,252,384,744.72	5,110,082,285.43

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易

不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上期末：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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

截至本基金本报告期末，无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	345,554,581.83	7.90
	其中：股票	345,554,581.83	7.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,906,830,162.89	89.27
	其中：债券	3,783,966,108.10	86.46
	资产支持证券	122,864,054.79	2.81
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	32,697,743.14	0.75
8	其他各项资产	91,491,275.04	2.09
9	合计	4,376,573,762.90	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	-	-
B	采矿业	3,667,528.00	0.12
C	制造业	126,477,338.75	4.18

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,856,300.00	0.49
E	建筑业	21,314,661.00	0.70
F	批发和零售业	3,883,074.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	2,580,620.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	33,813,494.00	1.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	8,748,000.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	215,341,015.75	7.12

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	28,664,978.85	0.95
日常消费品	5,809,208.20	0.19
能源	4,806,788.94	0.16
金融	36,535,264.91	1.21
医疗保健	-	-
工业	14,932,886.83	0.49
信息技术	13,562,397.42	0.45
通信服务	-	-
公用事业	25,902,040.93	0.86
房地产	-	-
合计	130,213,566.08	4.30

### 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	601233	桐昆股份	2,975,099	47,482,580.04	1.57
2	601336	新华保险	800,000	24,024,000.00	0.79
2	01336	新华保险	747,500	10,165,201.67	0.34
3	06862	海底捞	2,237,000	28,664,978.85	0.95

4	603225	新凤鸣	1,232,000	19,206,880.00	0.63
5	000063	中兴通讯	552,500	15,453,425.00	0.51
6	02380	中国电力	3,986,000	14,733,667.04	0.49
7	00697	首程控股	10,480,000	12,912,596.64	0.43
8	02628	中国人寿	1,140,000	11,486,625.41	0.38
8	601628	中国人寿	16,600	515,430.00	0.02
9	600502	安徽建工	2,675,300	11,503,790.00	0.38
10	002039	黔源电力	642,000	11,299,200.00	0.37
11	00981	中芯国际	588,500	9,195,360.52	0.30
12	300347	泰格医药	180,000	8,748,000.00	0.29
13	00390	中国中铁	1,401,000	5,511,044.77	0.18
13	601390	中国中铁	495,300	3,229,356.00	0.11
14	000519	中兵红箭	500,000	7,335,000.00	0.24
15	600685	中船防务	245,000	6,835,500.00	0.23
16	01186	中国铁建	1,215,000	6,176,607.53	0.20
16	601186	中国铁建	50,000	428,500.00	0.01
17	605305	中际联合	229,449	5,917,489.71	0.20
18	00916	龙源电力	840,000	5,381,891.42	0.18
19	01088	中国神华	146,500	4,806,788.94	0.16
19	601088	中国神华	9,500	421,515.00	0.01
20	00168	青岛啤酒股份	100,000	4,755,062.80	0.16
21	002236	大华股份	300,000	4,638,000.00	0.15
22	300775	三角防务	150,000	4,590,000.00	0.15
23	01347	华虹半导体	217,000	4,367,036.90	0.14
24	600764	中国海防	200,000	3,926,000.00	0.13
25	00384	中国燃气	597,800	3,819,200.73	0.13
26	601601	中国太保	100,200	2,791,572.00	0.09
26	02601	中国太保	50,000	869,784.04	0.03
27	601061	中信金属	501,800	3,447,366.00	0.11
28	00144	招商局港口	306,000	3,245,234.53	0.11
29	600820	隧道股份	400,000	2,612,000.00	0.09
30	600970	中材国际	191,800	2,313,108.00	0.08
31	600236	桂冠电力	295,300	2,264,951.00	0.07
32	00836	华润电力	90,000	1,967,281.74	0.07
33	000650	仁和药业	317,200	1,871,480.00	0.06
34	000975	银泰黄金	100,000	1,629,000.00	0.05
35	01398	工商银行	260,000	1,101,057.15	0.04
35	601398	工商银行	77,800	443,460.00	0.01
36	603087	甘李药业	30,400	1,408,128.00	0.05
37	601333	广深铁路	400,000	1,296,000.00	0.04
38	600372	中航机载	100,000	1,197,000.00	0.04
39	00291	华润啤酒	44,000	1,054,145.40	0.03
40	600765	中航重机	50,000	1,020,000.00	0.03

41	000738	航发控制	50,000	1,003,500.00	0.03
42	601009	南京银行	55,800	579,762.00	0.02
43	601138	工业富联	17,200	471,280.00	0.02
44	601328	交通银行	59,400	443,718.00	0.01
45	600938	中国海油	13,400	442,200.00	0.01
46	003816	中国广核	95,300	441,239.00	0.01
47	601919	中远海控	28,400	439,916.00	0.01
48	600183	生益科技	20,800	438,048.00	0.01
49	600036	招商银行	12,800	437,632.00	0.01
50	601939	建设银行	59,000	436,600.00	0.01
51	601607	上海医药	22,800	435,708.00	0.01
52	600219	南山铝业	114,200	435,102.00	0.01
53	600018	上港集团	74,800	432,344.00	0.01
54	601166	兴业银行	24,400	429,928.00	0.01
55	600900	长江电力	14,800	428,016.00	0.01
56	601818	光大银行	134,800	427,316.00	0.01
57	600000	浦发银行	51,800	426,314.00	0.01
58	601800	中国交建	47,600	425,544.00	0.01
59	601838	成都银行	27,900	423,801.00	0.01
60	600795	国电电力	70,600	422,894.00	0.01
61	600926	杭州银行	32,300	421,515.00	0.01
62	600176	中国巨石	38,000	419,900.00	0.01
63	600019	宝钢股份	63,000	418,950.00	0.01
64	601318	中国平安	10,100	417,736.00	0.01
65	601872	招商轮船	48,800	412,360.00	0.01
66	600362	江西铜业	17,300	409,664.00	0.01
67	601668	中国建筑	76,500	406,215.00	0.01
68	002142	宁波银行	18,400	405,904.00	0.01
69	601229	上海银行	55,800	405,108.00	0.01
70	000538	云南白药	7,900	404,085.00	0.01
71	000651	格力电器	10,300	403,966.00	0.01
72	601898	中煤能源	32,100	400,608.00	0.01
73	600332	白云山	13,600	398,888.00	0.01
74	000425	徐工机械	55,500	396,825.00	0.01
75	002415	海康威视	12,800	395,648.00	0.01
76	600039	四川路桥	50,000	394,500.00	0.01
77	000001	平安银行	38,600	391,790.00	0.01
78	601225	陕西煤业	15,200	391,704.00	0.01
79	002736	国信证券	44,600	387,574.00	0.01
80	000983	山西焦煤	37,100	382,501.00	0.01
81	601117	中国化学	200	1,648.00	0.00
82	600015	华夏银行	200	1,280.00	0.00
83	601169	北京银行	200	1,168.00	0.00

84	601658	邮储银行	200	1,014.00	0.00
85	601288	农业银行	200	872.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601336	新华保险	24,447,038.00	0.84
1	01336	新华保险	10,783,397.38	0.37
2	02380	中国电力	26,559,180.84	0.91
3	600502	安徽建工	17,784,876.00	0.61
4	601061	中信金属	17,663,154.00	0.60
5	002039	黔源电力	15,669,987.00	0.54
6	001965	招商公路	15,229,777.15	0.52
7	06862	海底捞	13,714,002.86	0.47
8	601601	中国太保	9,535,090.00	0.33
8	02601	中国太保	3,967,144.48	0.14
9	02628	中国人寿	11,006,593.84	0.38
9	601628	中国人寿	1,494,632.00	0.05
10	601390	中国中铁	11,032,718.00	0.38
10	00390	中国中铁	278,225.36	0.01
11	601233	桐昆股份	11,229,911.00	0.38
12	00168	青岛啤酒股份	10,671,943.09	0.36
13	601006	大秦铁路	9,463,922.00	0.32
14	300347	泰格医药	9,312,102.00	0.32
15	00384	中国燃气	9,266,223.52	0.32
16	603225	新凤鸣	9,066,331.00	0.31
17	000063	中兴通讯	8,832,606.00	0.30
18	01398	工商银行	7,052,064.80	0.24
18	601398	工商银行	923,287.00	0.03
19	605305	中际联合	7,872,200.56	0.27
20	601618	中国中冶	6,988,000.00	0.24
20	01618	中国中冶	769,244.00	0.03

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	01816	中广核电力	28,615,204.71	0.98
2	00883	中国海洋石油	23,050,458.51	0.79
2	600938	中国海油	636,002.00	0.02
3	605196	华通线缆	18,049,245.00	0.62

4	02380	中国电力	17,970,614.57	0.61
5	001965	招商公路	15,407,665.98	0.53
6	01398	工商银行	14,568,303.97	0.50
6	601398	工商银行	503,019.00	0.02
7	000778	新兴铸管	13,915,717.97	0.48
8	00552	中国通信服务	13,092,377.15	0.45
9	601390	中国中铁	8,614,408.00	0.29
9	00390	中国中铁	3,562,381.05	0.12
10	300969	恒帅股份	11,208,314.00	0.38
11	01088	中国神华	6,582,766.69	0.22
11	601088	中国神华	4,251,454.00	0.15
12	601061	中信金属	10,568,528.00	0.36
13	601601	中国太保	7,463,946.00	0.26
13	02601	中国太保	2,988,524.30	0.10
14	603228	景旺电子	10,392,585.00	0.36
15	00941	中国移动	10,058,725.53	0.34
16	300759	康龙化成	9,582,160.00	0.33
17	601006	大秦铁路	9,335,624.00	0.32
18	00144	招商局港口	9,021,089.49	0.31
19	01800	中国交通建设	8,843,273.71	0.30
20	601618	中国中冶	7,599,200.00	0.26
20	01618	中国中冶	811,148.50	0.03

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	435,047,251.18
卖出股票收入（成交）总额	551,971,748.29

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,899,929,279.47	62.78
	其中：政策性金融债	158,159,044.34	5.23
4	企业债券	685,677,441.02	22.66
5	企业短期融资券	91,439,245.90	3.02
6	中期票据	448,386,811.26	14.82
7	可转债（可交换债）	601,449,195.30	19.87
8	同业存单	-	-

9	其他	57,084,135.15	1.89
10	合计	3,783,966,108.10	125.03

### 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	2023005	20 平安人寿	1,800,000	183,625,269.04	6.07
2	2020022	20 南京银行二级 01	1,400,000	142,428,957.81	4.71
3	232380021	23 浙商银行二级资本债 01	1,300,000	136,280,275.07	4.50
4	2128042	21 兴业银行二级 02	1,000,000	105,659,665.75	3.49
5	175721	21 华泰 C1	800,000	84,159,232.88	2.78

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	183269	铁托 4 优	700,000	71,518,305.75	2.36
2	260785	工鑫 21A	200,000	20,788,915.07	0.69
3	261543	先锋 4C01	200,000	20,293,178.08	0.67
4	193797	21 工鑫 8A	100,000	10,263,655.89	0.34

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，谨慎进行对国债期货的投资。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平安人寿保险股份有限公司、南京银行股份有

限公司、浙商银行股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中铁信托有限责任公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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备选股票库的情形。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	269,267.50
2	应收清算款	88,493,256.59
3	应收股利	2,728,750.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	91,491,275.04

### 7.11.4 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	113056	重银转债	44,357,634.65	1.47
2	110047	山鹰转债	42,540,932.23	1.41
3	113050	南银转债	41,404,798.94	1.37
4	113033	利群转债	31,575,289.66	1.04
5	113641	华友转债	25,526,056.64	0.84
6	113058	友发转债	20,773,912.58	0.69
7	113530	大丰转债	19,866,821.92	0.66
8	113048	晶科转债	15,121,095.89	0.50
9	123146	中环转 2	14,430,175.41	0.48
10	123193	海能转债	13,982,758.56	0.46
11	127034	绿茵转债	12,990,094.48	0.43
12	128105	长集转债	12,401,924.84	0.41
13	118031	天 23 转债	11,634,259.48	0.38
14	127032	苏行转债	11,604,273.71	0.38
15	128138	侨银转债	11,515,634.94	0.38
16	113065	齐鲁转债	11,423,701.14	0.38
17	110079	杭银转债	8,875,183.94	0.29
18	110063	鹰 19 转债	8,112,671.23	0.27
19	123154	火星转债	7,891,525.14	0.26
20	118028	会通转债	7,791,562.25	0.26

21	123071	天能转债	6,834,181.93	0.23
22	127016	鲁泰转债	6,553,529.21	0.22
23	128081	海亮转债	6,510,350.14	0.22
24	123190	道氏转 02	5,918,754.93	0.20
25	113636	甬金转债	5,695,034.25	0.19
26	113542	好客转债	5,215,215.81	0.17
27	123104	卫宁转债	5,165,180.14	0.17
28	123165	回天转债	5,155,034.25	0.17
29	127045	牧原转债	5,141,332.14	0.17
30	118022	锂科转债	5,098,310.38	0.17
31	113044	大秦转债	5,075,187.05	0.17
32	110084	贵燃转债	5,010,232.80	0.17
33	111010	立昂转债	4,426,838.36	0.15
34	128048	张行转债	4,380,504.11	0.14
35	113633	科沃转债	4,295,493.22	0.14
36	128130	景兴转债	4,257,717.25	0.14
37	118005	天奈转债	3,832,768.79	0.13
38	127068	顺博转债	3,715,790.68	0.12
39	128117	道恩转债	3,545,998.42	0.12
40	113062	常银转债	3,526,224.12	0.12
41	113653	永 22 转债	3,422,107.62	0.11
42	127040	国泰转债	3,405,063.29	0.11
43	123115	捷捷转债	3,322,068.49	0.11
44	123109	昌红转债	3,311,327.67	0.11
45	128125	华阳转债	3,122,179.42	0.10
46	111000	起帆转债	2,993,901.32	0.10
47	128144	利民转债	2,975,311.27	0.10
48	128109	楚江转债	2,779,972.44	0.09
49	128049	华源转债	2,731,021.71	0.09
50	113532	海环转债	2,674,342.34	0.09
51	127059	永东转 2	2,672,058.29	0.09
52	123113	仙乐转债	2,552,000.00	0.08
53	110062	烽火转债	2,373,549.25	0.08
54	128071	合兴转债	2,165,170.41	0.07
55	113644	艾迪转债	2,153,175.34	0.07
56	113679	芯能转债	2,124,461.37	0.07
57	128129	青农转债	1,813,381.41	0.06
58	113623	凤 21 转债	1,805,677.08	0.06
59	111004	明新转债	1,700,221.37	0.06
60	110093	神马转债	1,695,128.42	0.06
61	127101	豪鹏转债	1,658,868.01	0.05
62	123174	精锻转债	1,612,485.62	0.05
63	113657	再 22 转债	1,531,633.37	0.05

64	127051	博杰转债	1,528,874.79	0.05
65	113665	汇通转债	1,512,624.62	0.05
66	113054	绿动转债	1,373,264.08	0.05
67	127074	麦米转 2	1,227,837.72	0.04
68	123120	隆华转债	1,113,264.38	0.04
69	123208	孩王转债	1,083,048.77	0.04
70	123169	正海转债	1,081,028.77	0.04
71	118024	冠宇转债	1,041,712.74	0.03
72	123085	万顺转 2	1,011,894.78	0.03
73	118032	建龙转债	999,060.27	0.03
74	123225	翔丰转债	958,295.93	0.03
75	123130	设研转债	949,786.31	0.03
76	127027	能化转债	941,959.22	0.03
77	123107	温氏转债	932,610.91	0.03
78	113606	荣泰转债	932,603.75	0.03
79	113658	密卫转债	914,910.38	0.03
80	113545	金能转债	863,806.03	0.03
81	127042	嘉美转债	844,916.16	0.03
82	110095	双良转债	843,498.20	0.03
83	113647	禾丰转债	586,890.48	0.02
84	128087	孚日转债	255,010.74	0.01
85	110087	天业转债	123,440.24	0.00
86	128141	旺能转债	82,457.56	0.00

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
28	103,928,500.88	2,909,998,024.75	100.0000	-	-

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.3 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：报告期末本公司高级管理人员、基金投资和研  
究部门负责人、本基金基金经理均未持有本基  
金。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额 占基 金总 份 额 比 例 (%)	发起份 额 总 数	发起份 额 占 基 金总 份 额 比 例(%)	发起份 额 承 诺 持 有 期 限
基金管理人固有 资金	10,000,000.00	0.3436	10,000,000.00	0.3436	3年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	2,899,998,000.00	99.6564	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	2,909,998,000.00	100.0000	10,000,000.00	0.3436	3年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年6月24日） 基金份额总额	2,909,998,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,909,998,024.75
本报告期基金总申购份额	-
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	2,909,998,024.75

## § 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，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发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及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。

### 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，本基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

## 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 (%)	
广发证券	1	325,648,350.55	33.82	249,150.02	33.91	-
开源证券	1	267,098,354.96	27.74	206,070.82	28.05	-
长江证券	1	160,347,829.11	16.65	118,283.91	16.10	-
国金证券	1	122,075,828.75	12.68	96,110.76	13.08	-
中信建投证券	1	70,421,535.00	7.31	51,822.66	7.05	-

华创证券	2	17,232,818.95	1.79	13,254.36	1.80	-
------	---	---------------	------	-----------	------	---

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控制度，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，基金租用证券公司交易单元无变化。

## 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(%)
广发证券	888,197,036.78	50.98	7,815,066,000.00	35.24	-	-
开源证券	243,567,875.68	13.98	8,048,401,000.00	36.29	-	-
长江证券	387,796,548.38	22.26	1,971,276,000.00	8.89	-	-
国金证券	60,099,226.19	3.45	1,464,617,000.00	6.60	-	-
中信建投证券	102,907,865.00	5.91	1,703,803,000.00	7.68	-	-

华创证 券	59,800,943. 83	3.43	1,174,195,00 0.00	5.29	-	-
----------	-------------------	------	----------------------	------	---	---

### 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	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
2	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 30 日
3	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 20 日
4	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 20 日
5	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
6	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	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	2,899,998 ,000.00	-	-	2,899,998,000 .00	99.65 64

#### 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、《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼，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](http://www.taipingfund.com.cn)

太平基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日