

太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证
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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 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 | 7 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 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 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 36 |
| 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 | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 36 |
| 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 | 36 |
| 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 | 37 |
| 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 | 37 |

| | |
|--|-----------|
| 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 | 37 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 37 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 37 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 37 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 38 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 38 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 38 |
| 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 | 38 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 38 |
| § 10 重大事件揭示 | 39 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 39 |
| 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 | 39 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 39 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 39 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 39 |
| 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 | 39 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 39 |
| 10.8 其他重大事件 | 41 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 42 |
| 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 | 42 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 42 |
| § 12 备查文件目录 | 42 |
| 12.1 备查文件目录 | 42 |
| 12.2 存放地点 | 43 |
| 12.3 查阅方式 | 43 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------------|
| 基金名称 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 |
| 基金简称 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有 |
| 基金主代码 | 017563 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 1 月 18 日 |
| 基金管理人 | 太平基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 194,488,886.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。 |
| 投资策略 | <p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。</p> <p>1、优化抽样复制策略</p> <p>本基金为指数基金，采用优化抽样复制法。</p> <p>通过对标的指数中各成份券的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的成份券构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券和备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券和备选成份券外寻找其他同业存单构建替代组合，对指数进行跟踪复制。</p> <p>替代组合的构建将以同业存单流动性为约束条件，按照与被替代同业存单久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代成份券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份券的退市风险、其在指数中的权重以及对</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>跟踪误差的影响，据此制定成份券替代策略，并对投资组合进行相应调整。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。另外，本基金债券投资将适当运用杠杆策略，通过债券回购融入资金，然后买入收益率更高的债券以获得收益。</p> <p>(1) 久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素，确定组合的整体久期，有效控制基金资产风险。</p> <p>(2) 收益率曲线策略是指在确定组合久期以后，根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理，确定组合期限结构的分布方式，合理配置不同期限品种的配置比例。</p> <p>(3) 类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上，根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重，即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为主要投资于同业存单的混合型指数基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。 |

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 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 赵霖 |
| | 联系电话 | 021-38556613 |
| | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn |
| 客户服务电话 | 021-61560999/400-028-8699 | 95595 |
| 传真 | 021-38556677 | 010-63639132 |
| 注册地址 | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室 | 北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 |
| 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 | 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心 |
| 邮政编码 | 200120 | 100033 |
| 法定代表人 | 焦艳军 | 吴利军 |

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 | www.taipingfund.com.cn |

| | |
|------------|-----------------------------|
| 址 | |
| 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 | 516,616.72 |
| 本期利润 | 643,273.61 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0083 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.81% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.79% |
| 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 | 4,978,473.50 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0256 |
| 期末基金资产净值 | 199,706,712.85 |
| 期末基金份额净值 | 1.0268 |
| 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 | 2.68% |

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

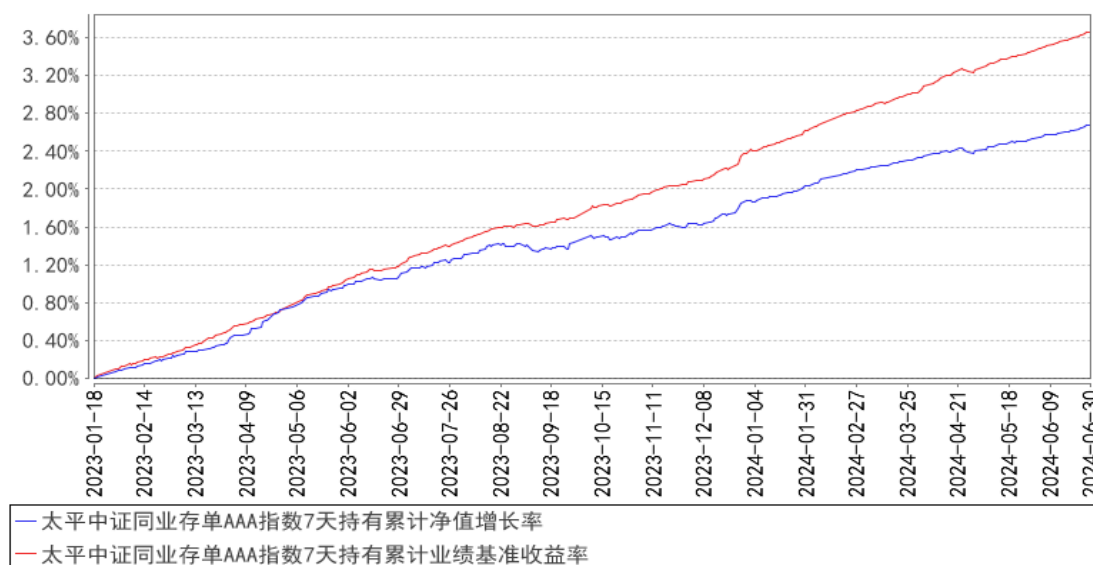
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.14% | 0.00% | 0.19% | 0.01% | -0.05% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.34% | 0.01% | 0.62% | 0.01% | -0.28% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.79% | 0.01% | 1.25% | 0.01% | -0.46% | 0.00% |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一年 | 1.55% | 0.01% | 2.42% | 0.01% | -0.87% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.68% | 0.01% | 3.66% | 0.01% | -0.98% | 0.00% |

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

太平中证同业存单AAA指数7天持有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 1 月 18 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 | | |
| 甘源 | 本基金的基金经理 | 2024 年 4 月 10 日 | - | 9 年 | 清华大学金融硕士，具有证券投资基金从业资格。2015 年起先后在中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、恒大研究院从事资金运营、宏观研究及货币研究等工作。2019 年 11 月加入太平基金管理有限公司。2021 年 2 月 22 日至 2023 年 4 月 10 日担任太平日日金货币市场基金基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2021 年 11 月 18 日起担任太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 21 日起担任太平睿庆混合型证券投资基金基金经理。2022 年 5 月 5 日至 2024 年 1 月 11 日担任太平安元债券型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 27 日至 2023 年 7 月 13 日担任太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 4 月 10 日起担任太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。 |
| 赵岩 | 固定收益投资部助理总监、本基金的基金经理 | 2023 年 1 月 18 日 | 2024 年 4 月 10 日 | 12 年 | 华东理工大学经济学学士，具有证券投资基金从业资格。2008 年 7 月起曾先后任职于招商银行信用卡中心、上海中财期货有限公司。2012 年 6 月起任上海银叶投资有限公司投资助理、投资经理等职。2016 年 6 月加入本公司，担任投资经理、专户投资部助理总监等职，现任固定收益投资部助理总监。2020 年 10 月 29 日至 2023 年 7 月 13 日担任太平恒睿纯债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 1 月 20 日起担任太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 8 日起担任太平恒兴纯债债券型证券投资基金基金经理。2022 年 11 月 17 日起担任太平恒信 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022 年 12 月 9 日起担任太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 1 月 18 日至 2024 年 4 月 10 日担任太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 7 日起担任太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2024 年 6 月 6 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|-------------------------------|
| | | | | | 日起担任太平恒发三个月定期开放债券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 年上半年整体呈现经济基本面弱修复、货币政策稳健流动性平稳的局面，在预期调整和基本面的共同影响下，债市走强、资金平稳。

年初由于春节因素，整体投资进度较慢基本面偏弱，叠加开年资产荒环境下债券市场收益率大幅下行，随后维持较低的收益率水平窄幅波动进入阶段性的震荡市。开年社融信贷增速有所回

落、基本面预期不强、债券供给有限、资产荒、机构加大配置等多因素影响下，10 年期国债收益率一度下行接近 2.25% 到较低水平，长端和超长端利率债表现较好。3 月中下旬以后，央行多次提示长端收益率的变化、“手工补息”取消、地产政策频繁发力、供给开始放量等因素下，长端利率窄幅波动，中短端受益于资金向非银机构转移表现相对较好。

资金走势总体均衡。DR007 与 DR001 中枢平稳，略高于 7 天政策利率。同时，资金波动性也明显减弱，资金利率向下有底。另外，资金分层有所缓解，R007 与 DR007 利差有所回落。在资金价稳量足背景下，同业存单利率有所下行，但由于 DR007 维持平稳，对存单利率的进一步下行形成制约。

本基金主要投资于 AAA 级同业存单，跟踪中证同业存单指数久期，灵活使用杠杆，并通过短久期政金债短线交易增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 0.79%，同期业绩比较基准收益率为 1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年是中国经济动能转换的一年，整体经济缓慢修复，高质量发展下不同阶段对资本市场产生不同影响。当前宏观政策坚持稳字当头稳中求进、经济增速斜率处于磨底期地产政策稳而不刺激、通胀压力较小内需恢复相对温和、海外经济增长动能不强通胀有高位回落趋势但仍有粘性，仍需要精准有效的政策引导，扩大内需、提振信心。展望未来，预计宏观政策保持定力，继续在短期经济增长和长期结构调整中寻求平衡。在总需求弱复苏和稳健的政策力度下，债券市场有望维持震荡态势，关注政府债供给高峰下的货币政策及“资产荒”逻辑的演绎空间。资金预计短期以稳为主，在政策利率附近波动；中期关注货币政策等相关的变化。

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，中国光大银行股份有限公司在太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2024 年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 1,017,936.67 | 1,263,033.45 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 141.16 | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 119,746,966.18 | 139,061,095.81 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 119,746,966.18 | 139,061,095.81 |
| 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 | 79,060,615.79 | 75,410,870.78 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,055.00 | 7,413.97 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 199,826,714.80 | 215,742,414.01 |
| 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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | | 13,815.89 | 22,961.78 |
| 应付托管费 | | 3,453.97 | 5,740.46 |
| 应付销售服务费 | | 13,815.89 | 22,961.78 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 134.74 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 88,781.46 | 173,138.23 |
| 负债合计 | | 120,001.95 | 224,802.25 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 194,488,886.00 | 211,536,601.16 |
| 未分配利润 | 6.4.7.11 | 5,217,826.85 | 3,981,010.60 |
| 净资产合计 | | 199,706,712.85 | 215,517,611.76 |
| 负债和净资产总计 | | 199,826,714.80 | 215,742,414.01 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0268 元，基金份额总额 194,488,886.00 份。

6.2 利润表

会计主体：太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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 18 日（基金 合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 1,001,338.89 | 7,126,645.65 |
| 1. 利息收入 | | 64,479.08 | 4,877,156.28 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.12 | 6,169.42 | 636,755.12 |
| 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 | | 58,309.66 | 4,240,401.16 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 810,202.92 | 1,976,099.37 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | 810,202.92 | 1,976,099.37 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.15 | - | - |
| 收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|------------|--------------|
| 衍生工具收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 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 | 126,656.89 | 273,390.00 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.20 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 358,065.28 | 1,383,265.55 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 78,322.02 | 547,607.36 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 19,580.56 | 136,901.85 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 78,322.02 | 547,607.36 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 90,109.48 | 74,403.70 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 90,109.48 | 74,403.70 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.21 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 32.72 | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.22 | 91,698.48 | 76,745.28 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 643,273.61 | 5,743,380.10 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 643,273.61 | 5,743,380.10 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 643,273.61 | 5,743,380.10 |

6.3 净资产变动表

会计主体：太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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 | 211,536,601.16 | - | 3,981,010.60 | 215,517,611.76 |
| 二、本期期初净资产 | 211,536,601.16 | - | 3,981,010.60 | 215,517,611.76 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-” | -17,047,715.16 | - | 1,236,816.25 | -15,810,898.91 |

| | | | | |
|--|---|--------|---------------|-------------------|
| 号填列) | | | | |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 643,273.61 | 643,273.61 |
| (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) | -17,047,715.16 | - | 593,542.64 | -16,454,172.52 |
| 其中：1. 基金申购款 | 294,209,673.26 | - | 7,428,560.72 | 301,638,233.98 |
| 2. 基金赎回款 | -311,257,388.42 | - | -6,835,018.08 | -318,092,406.50 |
| (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 | 194,488,886.00 | - | 5,217,826.85 | 199,706,712.85 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2023 年 1 月 18 日(基金合同生效日)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 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 2,067,530,510.45 | - | - | 2,067,530,510.45 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -1,614,390,664.24 | - | 5,049,012.91 | -1,609,341,651.33 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 5,743,380.10 | 5,743,380.10 |
| (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) | -1,614,390,664.24 | - | -694,367.19 | -1,615,085,031.43 |
| 其中：1. 基金申购款 | 569,229,113.96 | - | 5,073,696.24 | 574,302,810.20 |
| 2. 基金赎回款 | -2,183,619,778.20 | - | -5,768,063.43 | -2,189,387,841.63 |

| | | | | |
|--|----------------|---|--------------|----------------|
| (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 | 453,139,846.21 | - | 5,049,012.91 | 458,188,859.12 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(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[2022]第 3034 号《关于准予太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》注册，由太平基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,067,321,627.70 元，业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)信会师报字(2023)第 ZA30027 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》于 2023 年 1 月 18 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,067,530,510.45 份基金份额，其中认购资金利息折合 208,882.75 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称“中国光大银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府支持债券、政府支持机构债券等)、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、现金等

货币市场工具等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券及其他含有权益属性的金融工具。本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%;本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金持有的现金或者到期日在一年以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。本基金的业绩比较基准为:中证同业存单 AAA 指数收益率 \times 95%+银行人民币一年定期存款利率(税后) \times 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 06 月 30 日的财务状况、2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 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

本半年度会计报表所采用的会计政策、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重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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 | 1,017,936.67 |
| 等于：本金 | 1,017,736.08 |
| 加：应计利息 | 200.59 |
| 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 | 1,017,936.67 |

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 | 2,017,044.11 | 10,736.22 | 2,027,136.22 | -644.11 |
| | 银行间市场 | 117,109,184.00 | 526,929.96 | 117,719,829.96 | 83,716.00 |
| | 合计 | 119,126,228.11 | 537,666.18 | 119,746,966.18 | 83,071.89 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 119,126,228.11 | 537,666.18 | 119,746,966.18 | 83,071.89 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有任何期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有任何黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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 | - | - |
| 银行间市场 | 79,060,615.79 | - |
| 合计 | 79,060,615.79 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末未计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 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 | 15,682.98 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 15,682.98 |
| 应付利息 | - |
| 预提审计费 | 13,426.14 |
| 预提_信息披露费 | 59,672.34 |
| 合计 | 88,781.46 |

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 | 211,536,601.16 | 211,536,601.16 |
| 本期申购 | 294,209,673.26 | 294,209,673.26 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -311,257,388.42 | -311,257,388.42 |
| 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 | 194,488,886.00 | 194,488,886.00 |

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 | 4,046,568.84 | -65,558.24 | 3,981,010.60 |
| 本期期初 | 4,046,568.84 | -65,558.24 | 3,981,010.60 |
| 本期利润 | 516,616.72 | 126,656.89 | 643,273.61 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 415,287.94 | 178,254.70 | 593,542.64 |
| 其中：基金申购款 | 7,174,702.73 | 253,857.99 | 7,428,560.72 |
| 金赎回款 | -6,759,414.79 | -75,603.29 | -6,835,018.08 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |

| | | | |
|-----|--------------|------------|--------------|
| 本期末 | 4,978,473.50 | 239,353.35 | 5,217,826.85 |
|-----|--------------|------------|--------------|

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 | 6,155.87 |
| 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 | 13.17 |
| 其他 | 0.38 |
| 合计 | 6,169.42 |

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 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 | 893,330.42 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -83,127.50 |
| 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 | 810,202.92 |

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 | 163,542,699.52 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 160,823,150.00 |

| | |
|----------|--------------|
| 减：应计利息总额 | 2,793,959.52 |
| 减：交易费用 | 8,717.50 |
| 买卖债券差价收入 | -83,127.50 |

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

6.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益申购差价收入。

6.4.7.16 贵金属投资收益

6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益赎回差价收入。

6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益申购差价收入。

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益其他投资收益。

6.4.7.18 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

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 | 126,656.89 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | 126,656.89 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 126,656.89 |

6.4.7.20 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 13,426.14 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 合计 | 91,698.48 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|---------------------|
| 太平基金管理有限公司（“太平基金”） | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 光大银行股份有限公司（“光大银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |

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

本基金在本报告期内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

本基金在本报告期内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

本基金在本报告期内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

本基金在本报告期内没有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 78,322.02 | 547,607.36 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 34,386.90 | 207,186.58 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 43,935.12 | 340,420.78 |

注：支付基金管理人太平基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 19,580.56 | 136,901.85 |

注：支付基金托管人中国光大银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有 |
| 太平基金 | 453.04 |
| 光大银行 | 7,072.31 |
| 合计 | 7,525.35 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有 |
| 太平基金 | 7,571.21 |
| 光大银行 | 259,497.85 |
| 合计 | 267,069.06 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金份额的基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给太平基金，再由太平基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.2%/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

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期内未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

本基金在本报告期内未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

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 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（-）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 6,335,282.65 | - |
| 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 | 6,335,282.65 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 3.2574% | - |

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|---------------------------------|----------|---|------------|
| | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | 2023 年 1 月 18 日（基金合同生效日）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 |
| 中国光大银行 | 1,017,936.67 | 6,155.87 | 5,986,940.48 | 121,767.71 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内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

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

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金、偏股混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券。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 | 5,079,942.62 | 20,068,950.82 |
| 合计 | 5,079,942.62 | 20,068,950.82 |

注：短期未评级债券为政策性金融债。

6.4.13.2 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 | 102,570,583.23 | 118,992,144.99 |
| 合计 | 102,570,583.23 | 118,992,144.99 |

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 | 2,027,136.22 | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 10,069,304.11 | - |
| 合计 | 12,096,440.33 | - |

注：长期未评级债券为政策性金融债。

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金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。于本报告期末，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。

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 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 | 1,017,936.67 | - | - | - | 1,017,936.67 |
| 存出保证金 | 141.16 | - | - | - | 141.16 |
| 交易性金融资产 | 119,746,966.18 | - | - | - | 119,746,966.18 |
| 买入返售金融资产 | 79,060,615.79 | - | - | - | 79,060,615.79 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,055.00 | 1,055.00 |
| 资产总计 | 199,825,659.80 | - | - | 1,055.00 | 199,826,714.80 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 13,815.89 | 13,815.89 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,453.97 | 3,453.97 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 13,815.89 | 13,815.89 |
| 应交税费 | - | - | - | 134.74 | 134.74 |
| 其他负债 | - | - | - | 88,781.46 | 88,781.46 |
| 负债总计 | - | - | - | 120,001.95 | 120,001.95 |
| 利率敏感度缺口 | 199,825,659.80 | - | - | -118,946.95 | 199,706,712.85 |
| 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 | 1,263,033.45 | - | - | - | 1,263,033.45 |
| 交易性金融资产 | 139,061,095.81 | - | - | - | 139,061,095.81 |
| 买入返售金融资产 | 75,410,870.78 | - | - | - | 75,410,870.78 |
| 应收申购款 | - | - | - | 7,413.97 | 7,413.97 |
| 资产总计 | 215,735,000.04 | - | - | 7,413.97 | 215,742,414.01 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 22,961.78 | 22,961.78 |
| 应付托管费 | - | - | - | 5,740.46 | 5,740.46 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 22,961.78 | 22,961.78 |
| 其他负债 | - | - | - | 173,138.23 | 173,138.23 |
| 负债总计 | - | - | - | 224,802.25 | 224,802.25 |
| 利率敏感度缺口 | 215,735,000.04 | - | - | -217,388.28 | 215,517,611.76 |

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 | 212, 127. 50 | 147, 459. 93 |
| | 2. 市场利率上升 25 个基点 | -211, 204. 76 | -146, 917. 51 |

6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，不参与股票、权证等资产的投资。于本期末，本基金未持有交易性权益类投资，因此无重大其他价格风险。

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 | - | - |
| 第二层次 | 119, 746, 966. 18 | 139, 061, 095. 81 |

| | | |
|------|----------------|----------------|
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 119,746,966.18 | 139,061,095.81 |

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 2024 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 119,746,966.18 | 59.93 |
| | 其中：债券 | 119,746,966.18 | 59.93 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 79,060,615.79 | 39.56 |
| | 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 | 1,017,936.67 | 0.51 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,196.16 | 0.00 |

| | | | |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 199,826,714.80 | 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 15,149,246.73 | 7.59 |
| | 其中：政策性金融债 | 15,149,246.73 | 7.59 |
| 4 | 企业债券 | 2,027,136.22 | 1.02 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 102,570,583.23 | 51.36 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 119,746,966.18 | 59.96 |

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 | 112406212 | 24 交通银行 CD212 | 190,000 | 18,828,198.47 | 9.43 |
| 2 | 112411062 | 24 平安银行 | 160,000 | 15,754,719.21 | 7.89 |

| | | | | | |
|---|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| | | CD062 | | | |
| 3 | 112415230 | 24 民生银行 CD230 | 160,000 | 15,708,940.27 | 7.87 |
| 4 | 112409119 | 24 浦发银行 CD119 | 110,000 | 10,836,023.75 | 5.43 |
| 5 | 092318003 | 23 农发清发 03 | 100,000 | 10,069,304.11 | 5.04 |

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

按照基金合同约定的投资范围，本基金不投资股指期货。

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 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不投资股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|--------|
| 1 | 存出保证金 | 141.16 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |

| | | |
|---|-------|----------|
| 5 | 应收申购款 | 1,055.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,196.16 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在前十名股票中存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) |
| 1,225 | 158,766.44 | 148,932,533.88 | 76.5764 | 45,556,352.12 | 23.4236 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 111,166.26 | 0.0572 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2023 年 1 月 18 日) 基金份额总额 | 2,067,530,510.45 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 211,536,601.16 |
| 本报告期基金总申购份额 | 294,209,673.26 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 311,257,388.42 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |

| | |
|-------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 194,488,886.00 |
|-------------|----------------|

§ 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无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 山西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券 | 1 | - | - | - | - | - |

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，本基金无新增租用交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------|--------------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 东方证券 | 2,016,700.00 | 100.00 | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-----------|-----------------|
| 1 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 1 月 2 日 |
| 2 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加招商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 1 月 18 日 |
| 3 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2023 年第四季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 1 月 22 日 |
| 4 | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券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 3 月 13 日 |
| 5 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加江苏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 3 月 28 日 |
| 6 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2023 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 3 月 30 日 |
| 7 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 4 月 12 日 |
| 8 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 13 日 |
| 9 | 太平基金管理有限公司太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 13 日 |
| 10 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 2 号） | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 11 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 |
| 12 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2024 年第一季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 13 | 太平基金管理有限公司关于太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金调整销售对象并修改招募说明书的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 6 月 12 日 |
| 14 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 3 号） | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 6 月 12 日 |

| | | | |
|----|--|-----------|-----------------|
| 15 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、定期定额投资公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 6 月 27 日 |
| 16 | 太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 (%) |
| 个人 | 1 | 20240103-20240613 | 32,942,078.95 | - | 32,942,078.95 | 0.00 | 0.0000 |
| 产品 | 2 | 20240613-20240619 | - | 48,729,147.41 | 24,362,258.35 | 24,366,889.06 | 12.5287 |
| 产品 | 3 | 20240621-20240624 | - | 29,238,816.95 | 9,748,488.98 | 19,490,327.97 | 10.0213 |
| 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、《太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》
- 3、《太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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

太平基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日