

# 太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式 证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 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                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 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       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 34        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 35        |
| 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       | 35        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 35        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 35        |
| 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      | 35        |
| 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   | 36        |
| 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   | 36        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 36        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 36        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                      | 36        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>37</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 37        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 37        |
| 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 .....   | 37        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                | 37        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>38</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>38</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 38        |
| 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 .....   | 38        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 38        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 38        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 38        |
| 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 .....      | 38        |
| 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 .....                        | 40        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>40</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 ..... | 40        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 41        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>41</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 41        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 41        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 41        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                          |
|------------|--------------------------|
| 基金名称       | 太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 太平绿色纯债一年定开债券发起式          |
| 基金主代码      | 016506                   |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式                 |
| 基金合同生效日    | 2022 年 12 月 9 日          |
| 基金管理人      | 太平基金管理有限公司               |
| 基金托管人      | 上海银行股份有限公司               |
| 报告期末基金份额总额 | 1,009,999,350.04 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，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的收益。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略 | <p>本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>在资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析，比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率，在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种，及债券与现金类资产之间进行动态调整。</p> <p>2、久期策略</p> <p>本基金将主要采取久期策略，通过自上而下的组合久期管理策略，实现对组合利率风险的有效控制。</p> <p>3、收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。</p> <p>4、骑乘策略</p> <p>本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。</p> <p>5、息差策略</p> <p>本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。</p> <p>6、债券选择策略</p> <p>根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>7、信用债投资策略</p> <p>信用债券相对国债等利率产品的信用利差是获取较高投资收益的来源，本基金将通过重点投资信用类债券，提高整体收益能力。本管理人在内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。</p> <p>8、绿色投资筛选策略</p> <p>本基金所定义的符合绿色投资理念的债券是指，募集资金主要用于绿色项目或支持绿色产业发展的债券。绿色项目或产业包括符合《中国证监会关于支持绿色债券发展的指导意见》、《绿色信贷指引》及沪深交易所关于开展绿色公司债券试点的相关要求、国家发展和改革委员会《绿色债券发行指引》、《绿色产业指导目录》和中国金融学会绿色金融专业委员会编制的《绿色债券支持项目目录》国际《绿色债券原则(GBP)》和《气候债券标准(CBI)》等的项目或产业。</p> <p>未来随着经济和技术的不断发展，在履行适当程序后，本基金将会不定期的更新符合绿色投资理念所涵盖的范围，以充分体现本基金的主题和特点。</p> <p>（二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，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—中国绿色债券全价指数收益率。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型证券投资基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                                | 基金托管人                        |
|-------------|------|--------------------------------------|------------------------------|
| 名称          |      | 太平基金管理有限公司                           | 上海银行股份有限公司                   |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 赵霖                                   | 周直毅                          |
|             | 联系电话 | 021-38556613                         | 021-68475608                 |
|             | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn           | custody@bosc.cn              |
| 客户服务电话      |      | 021-61560999/400-028-8699            | 95594                        |
| 传真          |      | 021-38556677                         | 021-68476901                 |
| 注册地址        |      | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室            | 上海市黄浦区中山南路 688 号             |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼、5 楼 503A | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层 |
| 邮政编码        |      | 200120                               | 200120                       |
| 法定代表人       |      | 刘冬                                   | 顾建忠                          |

## 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 10,153,686.58                       |
| 本期利润          | 4,885,888.63                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0048                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.45%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.45%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 59,211,065.28                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0586                              |
| 期末基金资产净值      | 1,082,208,672.92                    |
| 期末基金份额净值      | 1.0715                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 7.15%                               |

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。

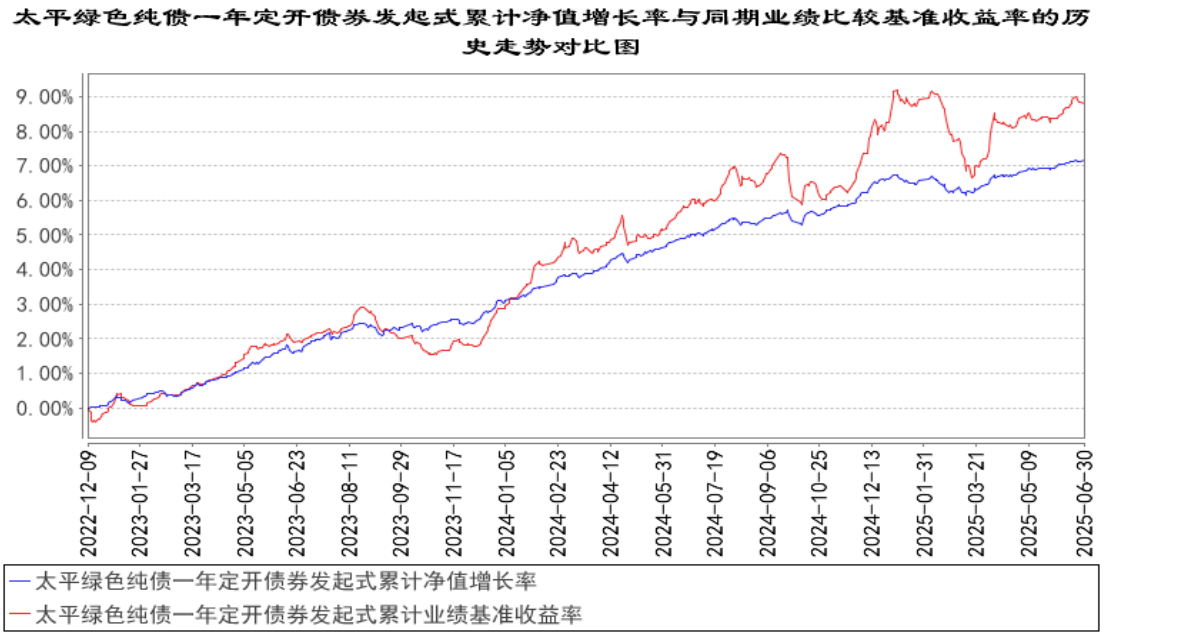
3.2 基金净值表现

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 | 0.19%    | 0.01%       | 0.41%      | 0.04%         | -0.22% | -0.03% |
| 过去三个月 | 0.65%    | 0.03%       | 1.48%      | 0.11%         | -0.83% | -0.08% |
| 过去六个月 | 0.45%    | 0.04%       | 0.29%      | 0.12%         | 0.16%  | -0.08% |
| 过去一年  | 2.02%    | 0.04%       | 2.62%      | 0.12%         | -0.60% | -0.08% |

|                |       |       |       |       |        |        |
|----------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 自基金合同生效起<br>至今 | 7.15% | 0.04% | 8.80% | 0.09% | -1.65% | -0.05% |
|----------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|

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



注：本基金基金合同生效日为 2022 年 12 月 09 日，本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 44 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 | 证券从 | 说明 |
|----|----|-----------|-----|----|
|----|----|-----------|-----|----|

|     |                      | (助理) 期限         |                 | 业年限  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|----------------------|-----------------|-----------------|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                      | 任职日期            | 离任日期            |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 朱燕琼 | 本基金的基金经理             | 2025 年 1 月 23 日 | -               | 11 年 | 北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 7 月起先后任埃克森美孚（中国）投资有限公司财务分析师、兴业国际信托有限公司投资经理、平安证券股份有限公司投资经理。2022 年 8 月加入本公司，现任固定收益投资部基金经理。2023 年 3 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。2023 年 4 月 10 日起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。2023 年 7 月 13 日起任太平恒睿纯债债券型证券投资基金基金经理。2025 年 1 月 23 日起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。2025 年 4 月 29 日起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 | 2022 年 12 月 9 日 | 2025 年 1 月 23 日 | 13 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 日至 2025 年 1 月 23 日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。2024 年 12 月 10 日起担任太平恒庆利 |

|  |  |  |  |  |                  |
|--|--|--|--|--|------------------|
|  |  |  |  |  | 率债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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，A 股呈现“政策驱动、情绪修复”主导的结构性行情。一季度 A 股延续震荡筑底，年初至 1 月中旬受风险情绪影响快速下跌，4 月初因贸易摩擦事件影响，市场出现回调，政策底显现后 5-6 月整体呈现探底修复态势，行业快速轮动。

本基金在报告期内保持中性仓位，较大幅度加仓汽车、家电及传媒，较大幅度的减持食品饮料

料板块，适度减持美容护理及商贸零食。同时在食品饮料板块中持续的调整细分领域的结构，较大幅度降低白酒配置，增配食品、啤酒等子板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.45%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

#### 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，地产有待企稳，经济内生动能依然存压，内外需存在下行压力，货币政策预计延续适度宽松基调，整体流动性环境对债市仍具支撑。但当前利率水平、信用利差均处于历史低位，票息保护不足，债券波动加大。下半年债市的潜在风险点有：宽财政发力超预期；市场整体风险偏好回升，资金从债券市场流出；反内卷政策效果超预期等。整体来看，今年的债券市场不再是单边牛市，在低利率水平更多呈现震荡状态，需要积极把握市场波动带来的波段性交易机会。

#### 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

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 566,281.81             | 2,004,312.18             |
| 结算备付金    |         | -                      | -                        |
| 存出保证金    |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 1,250,153,469.63       | 1,128,882,155.42         |
| 其中：股票投资  |         | -                      | -                        |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | 1,250,153,469.63       | 1,128,882,155.42         |
| 资产支持证券投资 |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                      | -                        |
| 其他投资     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产   | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 债权投资     | 6.4.7.5 | -                      | -                        |

|               |            |                                |                                  |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 1,250,719,751.44               | 1,130,886,467.60                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 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     |            | 168,068,017.22                 | 53,031,110.94                    |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 266,653.23                     | 273,111.41                       |
| 应付托管费         |            | 88,884.40                      | 91,037.14                        |
| 应付销售服务费       |            | -                              | -                                |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | -                              | -                                |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 87,523.67                      | 168,423.82                       |
| 负债合计          |            | 168,511,078.52                 | 53,563,683.31                    |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 1,009,999,350.04               | 1,009,999,350.04                 |
| 未分配利润         | 6.4.7.11   | 72,209,322.88                  | 67,323,434.25                    |
| 净资产合计         |            | 1,082,208,672.92               | 1,077,322,784.29                 |
| 负债和净资产总计      |            | 1,250,719,751.44               | 1,130,886,467.60                 |

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0715 元，基金份额总额 1,009,999,350.04 份。

6.2 利润表

会计主体：太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

|     |     |    |         |
|-----|-----|----|---------|
| 项 目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----|-----|----|---------|

|                            |            | 2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |            | 8,310,118.15                       | 23,085,586.19                      |
| 1. 利息收入                    |            | 14,454.08                          | 18,113.46                          |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.12   | 7,960.44                           | 15,395.89                          |
| 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                 |            | 6,493.64                           | 2,717.57                           |
| 其他利息收入                     |            | -                                  | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 13,563,462.02                      | 14,532,514.86                      |
| 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   | 13,563,462.02                      | 14,532,514.86                      |
| 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   | -5,267,797.95                      | 8,534,957.87                       |
| 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>           |            | 3,424,229.52                       | 3,760,733.59                       |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,602,827.64                       | 1,567,394.72                       |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -                                  | -                                  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 534,275.94                         | 522,464.90                         |
| 3. 销售服务费                   |            | -                                  | -                                  |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                                  | -                                  |
| 5. 利息支出                    |            | 1,188,618.01                       | 1,568,994.81                       |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 1,188,618.01                       | 1,568,994.81                       |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.21   | -                                  | -                                  |
| 7. 税金及附加                   |            | -                                  | -                                  |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.22   | 98,507.93                          | 101,879.16                         |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 4,885,888.63                       | 19,324,852.60                      |
| 减：所得税费用                    |            | -                                  | -                                  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”</b>       |            | 4,885,888.63                       | 19,324,852.60                      |

|               |  |              |               |
|---------------|--|--------------|---------------|
| 号填列)          |  |              |               |
| 五、其他综合收益的税后净额 |  | -            | -             |
| 六、综合收益总额      |  | 4,885,888.63 | 19,324,852.60 |

6.3 净资产变动表

会计主体：太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                           | 本期                              |               |                  |
|----------------------------------------------|---------------------------------|---------------|------------------|
|                                              | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |               |                  |
|                                              | 实收基金                            | 未分配利润         | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                    | 1,009,999,350.04                | 67,323,434.25 | 1,077,322,784.29 |
| 二、本期期初净资产                                    | 1,009,999,350.04                | 67,323,434.25 | 1,077,322,784.29 |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                     | -                               | 4,885,888.63  | 4,885,888.63     |
| (一)、综合收益总额                                   | -                               | 4,885,888.63  | 4,885,888.63     |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)      | -                               | -             | -                |
| 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<br>(净资产减少以“-”号填列) | -                               | -             | -                |
| 四、本期期末净资产                                    | 1,009,999,350.04                | 72,209,322.88 | 1,082,208,672.92 |
| 项目                                           | 上年度可比期间                         |               |                  |
|                                              | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |               |                  |
|                                              | 实收基金                            | 未分配利润         | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                    | 1,009,999,350.04                | 31,507,653.24 | 1,041,507,003.28 |
| 二、本期期初净资产                                    | 1,009,999,350.04                | 31,507,653.24 | 1,041,507,003.28 |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                     | -                               | 19,324,852.60 | 19,324,852.60    |

|                                          |                  |               |                  |
|------------------------------------------|------------------|---------------|------------------|
| (一)、综合收益总额                               | -                | 19,324,852.60 | 19,324,852.60    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -                | -             | -                |
| 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                                | 1,009,999,350.04 | 50,832,505.84 | 1,060,831,855.88 |

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>曹琦</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

太平绿色纯债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[2022]第 1718 号《关于准予太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式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《太平绿色纯债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 1,009,999,000.00 元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。经向中国证监会备案,《太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,009,999,350.04 份基金份额,其中认购资金利息折合 350.04 份基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司,基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,350.04 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《太平绿色纯债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要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等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等权益类资产，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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于符合绿色投资理念的债券不低于非现金基金资产的 80%；但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前一个月和开放期结束后一个月以及开放期间，基金投资不受前述投资组合比例限制。开放期内，本基金持有现金或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、存出保证金和应收申购款等；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为：中债—中国绿色债券全价指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金于本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金于本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入

应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 566,281.81             |
| 等于：本金          | 565,630.37             |
| 加：应计利息         | 651.44                 |
| 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             | 566,281.81             |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2025 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 | -                | -             | -                | -             |
|               | 银行间市场 | 1,224,804,742.40 | 12,350,469.63 | 1,250,153,469.63 | 12,998,257.60 |
|               | 合计    | 1,224,804,742.40 | 12,350,469.63 | 1,250,153,469.63 | 12,998,257.60 |
| 资产支持证券        |       | -                | -             | -                | -             |
| 基金            |       | -                | -             | -                | -             |
| 其他            |       | -                | -             | -                | -             |
| 合计            |       | 1,224,804,742.40 | 12,350,469.63 | 1,250,153,469.63 | 12,998,257.60 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金于本报告期末未持有任何期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金于本报告期末未持有任何黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金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

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025 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      | 8,180.51               |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 8,180.51               |
| 应付利息        | -                      |
| 预提信息披露费     | 59,507.37              |
| 预提审计费       | 19,835.79              |
| 合计          | 87,523.67              |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,009,999,350.04                      | 1,009,999,350.04 |
| 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           | 1,009,999,350.04                      | 1,009,999,350.04 |

注：申购含红利再投、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           | 49,057,378.70 | 18,266,055.55 | 67,323,434.25 |
| 本期期初           | 49,057,378.70 | 18,266,055.55 | 67,323,434.25 |
| 本期利润           | 10,153,686.58 | -5,267,797.95 | 4,885,888.63  |
| 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            | 59,211,065.28 | 12,998,257.60 | 72,209,322.88 |

#### 6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 7,960.44                              |
| 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 | -                                     |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 7,960.44                              |

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

本基金于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

本基金于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

本基金于本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 14,008,144.07              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -444,682.05                |
| 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                           | 13,563,462.02              |

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 262,275,738.49             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 260,198,192.05             |
| 减：应计利息总额               | 2,517,028.49               |
| 减：交易费用                 | 5,200.00                   |
| 买卖债券差价收入               | -444,682.05                |

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

6.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金于本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金于本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 贵金属投资收益

6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

本基金于本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金于本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金于本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金于本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.18 股利收益

本基金于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                              |
|------------|---------------------------------|
|            | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | -5,267,797.95                   |
| 股票投资       | -                               |
| 债券投资       | -5,267,797.95                   |
| 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                     | -5,267,797.95 |

#### 6.4.7.20 其他收入

本基金于本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.21 信用减值损失

本基金于本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 19,835.79                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行划款手续费 | 564.77                                |
| 账户维护费   | 18,600.00                             |
| 合计      | 98,507.93                             |

#### 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

截至本财务报告批准报出日，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 |
| 上海银行股份有限公司（“上海银行”） | 基金托管人               |

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,602,827.64                          | 1,567,394.72                               |
| 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    | 1,602,827.64                          | 1,567,394.72                               |

注：支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 534,275.94                            | 522,464.90                                 |

注：支付基金托管人上海银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月<br>30 日 |
|---------------------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 基金合同生效日（2022 年 12 月 9 日）持有的基金份额 | 10,000,350.04                            | 10,000,350.04                                 |
| 报告期初持有的基金份额                     | 10,000,350.04                            | 10,000,350.04                                 |
| 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                     | 10,000,350.04                            | 10,000,350.04                                 |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例         | 0.9901%                                  | 0.9901%                                       |

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<br>2025 年 6 月 30 日 |                             | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |                             |
|-------|------------------------|-----------------------------|--------------------------|-----------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例（%） | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） |

|      |                |         |                |         |
|------|----------------|---------|----------------|---------|
| 上海银行 | 999,999,000.00 | 99.0099 | 999,999,000.00 | 99.0099 |
|------|----------------|---------|----------------|---------|

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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    |
| 上海银行  | 566,281.81                            | 7,960.44 | 2,069,907.74                               | 13,477.88 |

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 168,068,017.22 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码   | 债券名称     | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|--------|----------|----------------|--------|---------|---------------|
| 220208 | 22 国开 08 | 2025 年 7 月 1 日 | 102.29 | 500,000 | 51,145,273.97 |
| 230208 | 23 国开 08 | 2025 年 7 月 1 日 | 102.95 | 500,000 | 51,472,726.03 |
| 250203 | 25 国开 03 | 2025 年 7 月 1 日 | 99.24  | 441,000 | 43,765,891.15 |

|         |              |                |        |           |                |
|---------|--------------|----------------|--------|-----------|----------------|
|         |              | 日              |        |           |                |
| 2228048 | 22 交通银行绿色金融债 | 2025 年 7 月 4 日 | 102.24 | 356,000   | 36,397,133.74  |
| 合计      |              |                |        | 1,797,000 | 182,781,024.89 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于证券投资基金中较低预期风险/收益的产品。本基金投资的金融工具主要包括具有良好流动性的固定收益类品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 808,075,386.86         | 870,576,369.32           |
| AAA 以下 | 122,491,101.37         | 121,457,556.16           |
| 未评级    | 319,586,981.40         | 136,848,229.94           |
| 合计     | 1,250,153,469.63       | 1,128,882,155.42         |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、长期未评级债券为政策性金融债、国债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于本期末，除卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)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，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金于本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 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                     | 566,281.81     | -              | -              | -           | 566,281.81       |
| 交易性金融资产                  | 621,723,634.52 | 522,031,892.06 | 106,397,943.05 | -           | 1,250,153,469.63 |
| 资产总计                     | 622,289,916.33 | 522,031,892.06 | 106,397,943.05 | -           | 1,250,719,751.44 |
| 负债                       |                |                |                |             |                  |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -              | 266,653.23  | 266,653.23       |
| 应付托管费                    | -              | -              | -              | 88,884.40   | 88,884.40        |
| 卖出回购金融资产款                | 168,068,017.22 | -              | -              | -           | 168,068,017.22   |
| 其他负债                     | -              | -              | -              | 87,523.67   | 87,523.67        |
| 负债总计                     | 168,068,017.22 | -              | -              | 443,061.30  | 168,511,078.52   |
| 利率敏感度缺口                  | 454,221,899.11 | 522,031,892.06 | 106,397,943.05 | -443,061.30 | 1,082,208,672.92 |
| 上年度末<br>2024 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                     | 2,004,312.18   | -              | -              | -           | 2,004,312.18     |
| 交易性金融资产                  | 497,153,222.46 | 599,736,908.50 | 31,992,024.46  | -           | 1,128,882,155.42 |
| 资产总计                     | 499,157,534.64 | 599,736,908.50 | 31,992,024.46  | -           | 1,130,886,467.60 |
| 负债                       |                |                |                |             |                  |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -              | 273,111.41  | 273,111.41       |
| 应付托管费                    | -              | -              | -              | 91,037.14   | 91,037.14        |
| 卖出回购金融资产款                | 53,031,110.94  | -              | -              | -           | 53,031,110.94    |
| 其他负债                     | -              | -              | -              | 168,423.82  | 168,423.82       |
| 负债总计                     | 53,031,110.94  | -              | -              | 532,572.37  | 53,563,683.31    |
| 利率敏感度缺口                  | 446,126,423.70 | 599,736,908.50 | 31,992,024.46  | -532,572.37 | 1,077,322,784.29 |

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（2025 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点                                  | 5,769,579.84                | 4,924,731.47           |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点                                  | -5,672,637.86               | -4,841,340.30          |

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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                      | -                        |
| 第二层次          | 1,250,153,469.63       | 1,128,882,155.42         |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 1,250,153,469.63       | 1,128,882,155.42         |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

|                            |
|----------------------------|
| 于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。 |
|----------------------------|

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

|                                                             |
|-------------------------------------------------------------|
| 于 2025 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（2024 年 12 月 31 日：同）。 |
|-------------------------------------------------------------|

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

|                                                               |
|---------------------------------------------------------------|
| 不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。 |
|---------------------------------------------------------------|

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

|                                              |
|----------------------------------------------|
| 于 2025 年 6 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           | 1,250,153,469.63 | 99.95         |
|    | 其中：债券            | 1,250,153,469.63 | 99.95         |
|    | 资产支持证券           | -                | -             |
| 4  | 贵金属投资            | -                | -             |
| 5  | 金融衍生品投资          | -                | -             |
| 6  | 买入返售金融资产         | -                | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资 | -                | -             |

|   |              |                  |        |
|---|--------------|------------------|--------|
|   | 产            |                  |        |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 566,281.81       | 0.05   |
| 8 | 其他各项资产       | -                | -      |
| 9 | 合计           | 1,250,719,751.44 | 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境内股票。

### 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投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

本基金本报告期内未持有股票。

### 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

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

## 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      | 21,457,071.82    | 1.98         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,228,696,397.81 | 113.54       |
|    | 其中：政策性金融债 | 298,129,909.58   | 27.55        |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,250,153,469.63 | 115.52       |

## 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 | 2228048   | 22 交通银行绿色金融债  | 1,000,000 | 102,239,139.73 | 9.45 |
| 2 | 2228056   | 22 平安银行绿色金融债  | 1,000,000 | 101,891,178.08 | 9.42 |
| 3 | 2320056   | 23 广州银行绿色债 02 | 900,000   | 92,961,419.18  | 8.59 |
| 4 | 2420009   | 24 江苏银行绿色债 02 | 900,000   | 91,911,037.81  | 8.49 |
| 5 | 222380003 | 23 兴业银行绿色债 01 | 900,000   | 91,458,631.23  | 8.45 |

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**7.10.1 本期国债期货投资政策**

按照基金合同约定的投资范围，本基金不投资国债期货。

**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，平安银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、国家开发银行、江苏张家港农村商业银行股份有限公司、江苏江阴农村商业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

**7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.11.3 期末其他各项资产构成**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 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<br>(户) | 户均持有的基金<br>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<br>例 (%) | 持有份额  | 占总份额比<br>例 (%) |
| 2            | 504, 999, 675. 02 | 1, 009, 999, 350. 04 | 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                 |

### 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<br>占基金总<br>份额比例<br>(%) | 发起份额总数           | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|------------------|-----------------------------|------------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 10, 000, 350. 04 | 0. 9901                     | 10, 000, 350. 04 | 0. 9901                 | 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     | -                | -                           | -                | -                       | -              |
| 其他          | -                | -                           | -                | -                       | -              |
| 合计          | 10, 000, 350. 04 | 0. 9901                     | 10, 000, 350. 04 | 0. 9901                 | 3 年            |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                  |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2022 年 12 月 9 日）<br>基金份额总额 | 1,009,999,350.04 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 1,009,999,350.04 |
| 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                       | 1,009,999,350.04 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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 (%) |    |
| 长江证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 广发证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |

注：1. 拟被基金管理人租用交易单元的证券公司应符合以下标准：

(1) 公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定。最近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。

(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要。

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

(6) 与公司签订综合服务协议。

2. 交易单元的选择程序：

(1) 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证券公司名单，由投资决策委员会在上述名单内确定租用的交易单元。

(2) 基金管理人与被选择的证券公司签订协议，租用交易单元开展证券交易。

3. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

本报告期内，本基金租用券商交易单元无变化。

### 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 (%) |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

注：本基金于本报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                                     | 法定披露方式    | 法定披露日期          |
|----|----------------------------------------------------------|-----------|-----------------|
| 1  | 关于太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换等业务公告              | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 1 月 8 日  |
| 2  | 关于太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金提前结束开放期并进入下一封闭期的公告             | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 1 月 17 日 |
| 3  | 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变更公告                         | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 1 月 25 日 |
| 4  | 太平基金管理有限公司太平绿色纯债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）（2025 年第 1 号） | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 1 月 27 日 |
| 5  | 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产品资料概要更新                       | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 1 月 27 日 |
| 6  | 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产品资料概要更新                       | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 4 月 20 日 |
| 7  | 太平绿色纯债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                          | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 4 月 20 日 |
| 8  | 太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年第一季度报告                    | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 9  | 太平基金管理有限公司关于终止北京中植基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告               | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 4 月 29 日 |
| 10 | 太平基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告             | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 6 月 4 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 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比（%） |

|                                                                                                                                            |   | 间区间                    |                    |   |   |                    |             |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|------------------------|--------------------|---|---|--------------------|-------------|
| 机构                                                                                                                                         | 1 | 20250101 -<br>20250630 | 999,999,0<br>00.00 | - | - | 999,999,000.0<br>0 | 99.00<br>99 |
| 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、《太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平绿色纯债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 5 楼 503A)

12.3 查阅方式

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

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司  
2025 年 8 月 30 日