# 太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金
# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 太平丰盈一年定开债券发起式 |
| 基金主代码 | 011327 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,356,340,681.41 份 |
| 投资目标 | 本基金在追求资产长期稳健增值的基础上，力争为份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产、权益类资产、现金类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，以规避市场风险，提高基金收益率。<br>（一）封闭期投资策略<br>本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、资产支持证券投资策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。<br>（二）开放期投资策略<br>在开放期，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化，基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。 |
| 业绩比较基准 | 中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+中 |

| | |
|---|---|
| | 证可转换债券指数收益率*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 太平基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |

注：根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金自 2026 年 9 月 21 日起调整业绩比较基准。

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 48,229,441.55 |
| 2.本期利润 | 85,035,737.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0253 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,766,077,169.56 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1221 |

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、所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 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.32% | 0.16% | -0.96% | 0.13% | 3.28% | 0.03% |
| 过去六个月 | 3.75% | 0.19% | 0.77% | 0.14% | 2.98% | 0.05% |
| 过去一年 | 4.81% | 0.19% | 0.69% | 0.12% | 4.12% | 0.07% |
| 过去三年 | 15.26% | 0.27% | 7.16% | 0.12% | 8.10% | 0.15% |
| 过去五年 | 13.11% | 0.28% | 6.73% | 0.11% | 6.38% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.21% | 0.27% | 7.26% | 0.11% | 4.95% | 0.16% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 04 月 22 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。

2、为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经基金管理人与基金托管人协商一致，本基金自 2026 年 9 月 21 日起调整业绩比较基准。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 赵鑫淼 | 本基金的基金经理 | 2026 年 7 月 10 日 | - | 7 年 | 上海交通大学应用统计硕士，具有证券投资基金从业资格。曾任职于德邦基金管理有限公司，任量化研究员。2022 年 12 月加入本公司。2026 年 4 月 29 日至 2026 年 8 月 15 日担任太平低碳经济混合型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 7 月 10 日起担任太平科创精选混合型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 7 月 10 日起担任太平嘉信债券型证券投资基金基金经理。2026 年 7 月 10 日起担任太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2026 年 7 月 10 日起担任太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
| 史彦刚 | 公司助理 | 2023 年 6 月 2 | - | 19 年 | 中国人民大学经济学硕士。曾就职于中国 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 总经理、本基金的基金经理 | 日 | | | 工商银行、中国银行业监督管理委员会、中信银行，2007 年 9 月起先后任嘉实基金管理有限公司信用分析师、国泰基金管理有限公司投资经理、长城基金管理有限公司基金经理、格林基金管理有限公司副总经理等职务。2020 年 4 月加入太平基金管理有限公司，现任公司助理总经理。2023 年 6 月 2 日起担任太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 12 日起担任太平安元债券型证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 12 日起担任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 12 日起担任太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 12 日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 16 日起担任太平嘉信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，不存在违法违规或未履行基金合同的情形。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及有关法规，建立公司内部的公平交易管理制度体系，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，以确保公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，防范不公平交易和利益输送行为。

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相关制度的有关规定，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，海外地缘博弈持续，主要经济体货币政策路径分歧加大。国内 AI 产业链与库存周期带动内需结构性复苏，地产仍处于筑底阶段，制造业投资结构优化，经济总体平稳，但物价分化与内需不确定性仍存。货币政策延续适度宽松基调，但总量工具保持定力，以结构性精准调控为主。9 月末国常会部署加大逆周期调节，推出增量政策。财政端加速政府债发行并用好债务结存限额稳定投资，协同央行推出房贷贴息与 PSL 降息扩围，结构性工具精准支持科创、基建与民企。

权益市场延续结构性分化，风险偏好收敛，轮动加快、波动放大。前期强势的科创领域调整相对较多，创业板指创单季度最大跌幅；煤炭、石油石化等防御板块逆势上涨。债市在经济弱修复与资金面合理充裕下震荡下行，曲线平坦化，5 年期信用债受摊余债基配置需求影响下行到前期低位。可转债估值性价比下降，存量收缩，个券分化加剧。

本基金股票仓位保持在 10-15%，以低估值、业绩相对确定的大盘股作为底仓，优选估值相对合理、业绩相对确定的个股。同时密切关注成长股带来的从 1 到 N 的投资机会，择机用适当仓位把握市场流动性变动和结构切换的交易机会，控制总体风险敞口和波动率，通过权益仓位、结构进行回撤的优化控制。债券以 3-5 年信用债和长期国债进行平衡配置，做好骑乘、久期的动态管理，保持 30-50%左右的杠杆，通过长期国债换券轮动、久期波段操作，有效提升组合资本利得。转债保持低配，适当参与了临期转债交易机会和一级半转债溢价回归后的配置机会。

展望四季度，随着财政政策逐步显效，国内经济内生动能有望修复，国内外 AI 产业升级趋势不改，但是产业资本开支压力、需求端收入兑现程度的可见性相对下降。在逆全球化、主要国家加息背景下，需关注海外地缘政治局势变化和加息节奏。权益市场结构轮动加快，市场投资难度有所增加，我们将继续坚持价值底仓、成长辅助、科技+红利平衡的配置思路，兼顾安全边际与业绩确定性。债市或延续震荡，我们将坚持信用底仓、中性偏长久期、波段灵活、杠杆增厚的操作思路。可转债延续严控估值，寻找溢价率回归和基本面向上的长线配置机会。本基金将秉持稳健理念，努力为持有人创造长期可持续回报。

## 4.5 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 2.32%，同期业绩比较基准收益率为-0.96%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 559,250,781.50 | 10.18 |
| | 其中：股票 | 559,250,781.50 | 10.18 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 4,879,007,474.70 | 88.78 |
| | 其中：债券 | 4,879,007,474.70 | 88.78 |
| | 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 | 54,762,098.05 | 1.00 |
| 8 | 其他资产 | 2,602,279.91 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 5,495,622,634.16 | 100.00 |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,650,700.00 | 0.10 |
| B | 采矿业 | 13,875,684.00 | 0.37 |
| C | 制造业 | 346,123,321.23 | 9.19 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 23,249,357.00 | 0.62 |
| E | 建筑业 | 8,896,085.44 | 0.24 |
| F | 批发和零售业 | 4,634,891.52 | 0.12 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 55,226,426.54 | 1.47 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,240,717.00 | 0.51 |
| J | 金融业 | 58,520,248.17 | 1.55 |
| K | 房地产业 | 1,880,000.00 | 0.05 |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,789,643.00 | 0.21 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,564,600.00 | 0.12 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,536,131.60 | 0.07 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 5,131,220.00 | 0.14 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,931,756.00 | 0.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 559,250,781.50 | 14.85 |

## 5.2.2 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

## 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601398 | 工商银行 | 1,325,000 | 10,971,000.00 | 0.29 |
| 2 | 300760 | 迈瑞医疗 | 60,300 | 9,727,596.00 | 0.26 |
| 3 | 601609 | 金田股份 | 810,563 | 9,499,798.36 | 0.25 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 298,700 | 9,277,622.00 | 0.25 |
| 5 | 603733 | 仙鹤股份 | 521,531 | 9,251,959.94 | 0.25 |
| 6 | 000063 | 中兴通讯 | 290,000 | 8,868,200.00 | 0.24 |
| 7 | 600900 | 长江电力 | 306,700 | 8,753,218.00 | 0.23 |
| 8 | 600030 | 中信证券 | 330,033 | 8,534,653.38 | 0.23 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 28,700 | 8,354,857.00 | 0.22 |
| 10 | 600009 | 上海机场 | 367,880 | 8,306,730.40 | 0.22 |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 1,793,540,467.64 | 47.62 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 496,588,099.63 | 13.19 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 1,158,936,847.89 | 30.77 |
| 5 | 企业短期融资券 | 70,028,042.19 | 1.86 |
| 6 | 中期票据 | 1,102,505,875.62 | 29.27 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 157,750,332.94 | 4.19 |
| 8 | 同业存单 | 99,657,808.79 | 2.65 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 4,879,007,474.70 | 129.55 |

## 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 260002 | 26 附息国债 02 | 5,700,000 | 601,774,402.17 | 15.98 |
| 2 | 250002 | 25 附息国债 02 | 3,200,000 | 307,062,260.87 | 8.15 |
| 3 | 2600005 | 26超长特别国债 05 | 1,900,000 | 195,253,086.96 | 5.18 |
| 4 | 019767 | 25 国债 02 | 1,540,000 | 147,778,864.11 | 3.92 |
| 5 | 260017 | 26 附息国债 17 | 1,200,000 | 119,981,621.92 | 3.19 |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

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

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.9.3 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。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本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，兴业银行股份有限公司、交通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。

## 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定备选股票库。

## 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 620,848.19 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,981,431.72 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 2,602,279.91 |

## 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113042 | 上银转债 | 27,364,163.81 | 0.73 |
| 2 | 113043 | 财通转债 | 25,932,416.45 | 0.69 |
| 3 | 110100 | 龙建转债 | 18,017,534.26 | 0.48 |
| 4 | 127040 | 国泰转债 | 8,885,907.38 | 0.24 |
| 5 | 123114 | 三角转债 | 7,297,061.70 | 0.19 |
| 6 | 110076 | 华海转债 | 4,306,363.93 | 0.11 |
| 7 | 113616 | 韦尔转债 | 3,834,748.63 | 0.10 |
| 8 | 118005 | 天奈转债 | 3,754,137.85 | 0.10 |
| 9 | 113605 | 大参转债 | 3,659,632.19 | 0.10 |
| 10 | 123150 | 九强转债 | 3,585,982.35 | 0.10 |
| 11 | 113688 | 国检转债 | 3,576,897.57 | 0.09 |
| 12 | 113046 | 金田转债 | 3,441,780.82 | 0.09 |
| 13 | 113052 | 兴业转债 | 3,169,079.89 | 0.08 |
| 14 | 127049 | 希望转 2 | 2,894,518.30 | 0.08 |
| 15 | 110086 | 精工转债 | 2,729,761.77 | 0.07 |
| 16 | 110084 | 贵燃转债 | 2,582,443.47 | 0.07 |
| 17 | 113648 | 巨星转债 | 1,812,545.75 | 0.05 |
| 18 | 111017 | 蓝天转债 | 1,554,855.19 | 0.04 |
| 19 | 113661 | 福 22 转债 | 1,542,801.82 | 0.04 |
| 20 | 110093 | 神马转债 | 1,481,600.61 | 0.04 |
| 21 | 123117 | 健帆转债 | 1,418,709.90 | 0.04 |
| 22 | 123113 | 仙乐转债 | 1,383,668.81 | 0.04 |
| 23 | 127110 | 广核转债 | 1,092,269.15 | 0.03 |
| 24 | 113051 | 节能转债 | 927,176.99 | 0.02 |
| 25 | 127045 | 牧原转债 | 908,304.66 | 0.02 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 26 | 110099 | 福能转债 | 867,568.44 | 0.02 |
| 27 | 110090 | 爱迪转债 | 749,317.81 | 0.02 |
| 28 | 110098 | 南药转债 | 524,941.92 | 0.01 |
| 29 | 123266 | 博士转债 | 134,733.17 | 0.00 |
| 30 | 127050 | 麒麟转债 | 53,486.21 | 0.00 |
| 31 | 123263 | 鼎捷转债 | 30,970.01 | 0.00 |
| 32 | 118066 | 统联转债 | 6,247.17 | 0.00 |

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.10.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 3,356,341,704.18 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 1,022.77 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,356,340,681.41 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 19,184,423.22 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 19,184,423.22 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.5716 |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

# §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 19,184,423.22 | 0.5716 | 10,000,000.00 | 0.2979 | 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 | 3,337,154,938.89 | 99.4284 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 3,356,339,362.11 | 100.0000 | 10,000,000.00 | 0.2979 | 3 年 |

# § 9 影响投资者决策的其他重要信息

## 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 20260701 - 20260930 | 3,337,154,938.89 | - | - | 3,337,154,938.89 | 99.4284 |
| 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。 | | | | | | | |

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §10 备查文件目录

## 10.1 备查文件目录

1、中国证监会关于核准本基金募集的批复

2、《太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

3、《太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》

4、《太平丰盈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

## 10.2 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)

## 10.3 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**

**2026 年 10 月 27 日**