太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金清算报告

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

报告出具日期：二〇二六年十一月六日

报告公告日期：二〇二六年十一月十七日

目录

太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金清算报告 1
1、重要提示 2
2、基金概况 2
3、基金运作情况说明 4
4、财务报告 5
5、清算情况 6
6、备查文件目录 8

1、重要提示

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]1718号予以注册，2022年12月9日基金合同生效。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司（以下简称“太平基金”或“基金管理人”），本基金托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”或“基金托管人”）。

因市场环境变化，为维护基金份额持有人的利益，根据《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》等法律法规以及《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》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金的基金管理人太平基金经与基金托管人上海银行协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于终止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有关事项的议案》，并由参加基金份额持有人大会的基金份额持有人对本次会议议案进行表决。本次基金份额持有人大会表决投票时间从2026年9月11日至2026年10月11日止。根据基金管理人2026年10月13日公告的《太平基金管理有限公司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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议生效公告》”），本次基金份额持有人大会于2026年10月12日计票表决通过了上述议案，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》，本基金最后运作日为2026年10月13日，自2026年10月14日起进入清算期。

本基金管理人太平基金、基金托管人上海银行、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2026年10月14日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

2、基金概况

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
基金最后运作日（2026年10月13日）基金份额总额	49,500,350.04份

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。
投资范围	本基金的投资范围主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。 基金的投资组合比例为：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。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。
主要投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。

	（一）封闭期投资策略包括：资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略、信用债投资策略、绿色投资筛选策略。 （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。
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。

3、基金运作情况说明

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”）系由基金管理人太平基金依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》（以下简称“《基金合同》”）及其他有关法律法规的规定，经中国证监会证监许可[2022]1718号批准公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为1,009,999,350.04份，经立信会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。基金合同于2022年12月9日正式生效。本基金的管理人为太平基金管理有限公司，托管人为上海银行股份有限公司。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

因市场环境变化，为维护基金份额持有人利益，根据《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》等法律法规以及《基金合同》的规定，基金管理人经与本基金基金托管人协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于终止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有关事项的议案》。根据基金管理人2026年10月13日公告的《太平基金管理有限公司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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》（以下简称“《决议生效公告》”），本次基金份额持有人大会于2026年10

月12日表决通过了上述议案，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》，本基金最后运作日为2026年10月13日，自2026年10月14日进入清算期。

4、财务报告

4.1基金最后运作日资产负债表（已经审计）

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：2026年10月13日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	最后运作日 2026年10月13日
资产：	
货币资金	3,518,132.61
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	50,285,575.34
其中：债券投资	50,285,575.34
资产合计	**53,803,707.95**
负债和净资产	**最后运作日 2026年10月13日**
负债：	
应付清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	5,745.13
应付托管费	1,915.03
应付销售服务费	-
其他负债	17,600.00
负债合计	**25,260.16**
净资产：	
实收基金	49,500,350.04
未分配利润	4,278,097.75
净资产合计	53,778,447.79
负债和净资产总计	**53,803,707.95**

注1：报告截止日2026年10月13日（基金最后运作日），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份额净值为1.0864元，份额总额为49,500,350.04份。

注2：本报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于2026年10月13日（基金最后运作日），所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致，本报表并无比较期间的相关数据列示。

注3：本报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师张楠、许雯签字出具了毕马威华振审字第2629019号标准无保留意见的审计报告。

5、清算情况

自 2026年10月14日起至2026年11月02日止的清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用。按照《基金合同》的规定，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5.2资产处置情况

本基金最后运作日银行存款金额为3,518,132.61元，其中包含应计活期存款利息为2,948.57元，前述利息将于2026年12月21日收回。

本基金最后运作日交易性金融资产估值金额为人民币50,285,575.34元，其中债券投资为50,285,575.34元，已于2026年10月19日全部变现并划入托管户。

5.3负债清偿情况

1）本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币5,745.13元，已于2026年10月20日支付。

2）本基金最后运作日应付托管人报酬为人民币1,915.03元，已于2026年10月20日支付。

3）本基金最后运作日其他负债为人民币17,600.00元，系应付清算律师费10,000元，已于2026年10月20日支付；应付清算审计费7,600元，已于2026年11月02日支付。

5.4资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况（含清算期间损益情况）

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2026年10月13日基金净资产	**53,778,447.79**
加：清算期间（2026年10月14日至2026年11月02日）收入	18,133.80
1、存款利息收入	34,428.04

2、投资收益	50,755.76
3、公允价值变动损益	-67,050.00
减：清算期间（2026年10月14日至2026年11月02日）费用	13.00
1、其他费用	13.00
二、2026年11月02日（清算结束日）基金净资产	**53,796,568.59**

注1：存款利息收入系以当前适用的利率预估计提的自2026年10月14日至2026年11月02日止银行存款的利息。

注2：投资收益系最后运作日未变现债券自2026年10月14日至2026年10月19日止处置取得的投资收益，包含处置过程中发生的交易费用、交易型债券债券投资产生的投资收益及利息收入。

注3：公允价值变动损益系最后运作日未变现债券自2026年10月14日至2026年10月19日止结转的公允价值变动损益。

注4：其他费用系2026年10月月度银行汇划手续费13元，已于2026年11月02日支付。

资产处置及负债清偿后，截至本次清算期结束日2026年11月02日，本基金剩余财产为53,796,568.59元，根据本基金《基金合同》约定，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自本次清算期结束日次日2026年11月03日至清算款项支付日前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金利息归基金份额持有人所有，为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将以自有资金先行垫付该笔款项（该金额可能与实际结息金额存在略微差异），供清盘分配使用。基金管理人垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息将于清算期后返还给基金管理人。

5.5基金资产清算的告知及剩余财产分配安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

6、备查文件目录

6.1备查文件目录

6.1.1太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金清算财务报表及审计报告

6.1.2上海源泰律师事务所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清算事宜之法律意见

6.2存放地点

上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦7楼 本基金管理人办公场所

6.3查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅

太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二六年十一月六日