

太平恒安三个月定期开放债券型证券投资  
基金  
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 4.9 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       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 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 | 14        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 14        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>14</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 14        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 14        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>16</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 16        |
| 7.2 利润表                                 | 18        |
| 7.3 净资产变动表                              | 19        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>45</b> |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 45        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 46        |
| 8.3 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 .....     | 46        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 46        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 46        |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 46        |
| 8.7 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 ..... | 47        |
| 8.8 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 ..... | 47        |
| 8.9 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 .....    | 47        |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 47        |
| 8.11 投资组合报告附注 .....                         | 47        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>48</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 48        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 48        |
| 9.3 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 .....      | 48        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>48</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>49</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 49        |
| 11.2 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 .....      | 49        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 49        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 49        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 49        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 49        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 50        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 50        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>52</b> |
| 12.1 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 .....    | 52        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 52        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 53        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 53        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 53        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 太平恒安三个月定开债           |
| 基金主代码      | 007545               |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式             |
| 基金合同生效日    | 2019 年 6 月 27 日      |
| 基金管理人      | 太平基金管理有限公司           |
| 基金托管人      | 江苏银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额 | 4,328,664,943.56 份   |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资策略 | <p>本基金将综合运用多种债券投资策略，实现组合增值，在有效控制风险的基础上，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。</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，以实现组合利率风险的有效控制。为控制风险，本基金采用以“目标久期”为中心的资产配置方式。目标久期的设定划分为两个层次：战略性配置和战术性配置。“目标久期”的战略性配置由投资决策委员会确定，主要根据对宏观经济和资本市场的预测分析决定组合的目标久期。“目标久期”的战术性配置由基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的范围内进行调整。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，直至接近目标久期上限，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，直至目标久期下限，以减小债券价格下降带来的风险。</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</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>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、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |

## 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                           | 江苏银行股份有限公司            |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 赵霖                                   | 周宏                    |
|             | 联系电话 | 021-38556613                         | 025-58588217          |
|             | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn           | zhouhong1@jsbchina.cn |
| 客户服务电话      |      | 021-61560999/400-028-8699            | 95319                 |
| 传真          |      | 021-38556677                         | 025-58588155          |
| 注册地址        |      | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室            | 南京市中华路 26 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 | 南京市中华路 26 号           |
| 邮政编码        |      | 200120                               | 210001                |
| 法定代表人       |      | 焦艳军                                  | 葛仁余                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》                      |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.taipingfund.com.cn      |
| 基金年度报告备置地点          | 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 |
|----|----|------|
|----|----|------|

|        |                          |                                |
|--------|--------------------------|--------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼      |
| 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<br>7 楼 |

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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 | 2023 年           | 2022 年           | 2021 年           |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 106,074,027.00   | 101,464,238.57   | 56,588,594.39    |
| 本期利润          | 142,883,885.09   | 54,375,084.59    | 68,073,324.86    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0384           | 0.0202           | 0.0537           |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.76%            | 1.89%            | 5.02%            |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.11%            | 2.39%            | 5.17%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023 年末          | 2022 年末          | 2021 年末          |
| 期末可供分配利润      | 46,778,238.81    | 91,607,185.98    | 92,439,700.51    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0108           | 0.0296           | 0.0400           |
| 期末基金资产净值      | 4,397,075,858.83 | 3,182,357,100.01 | 2,413,529,544.46 |
| 期末基金份额净值      | 1.0158           | 1.0296           | 1.0450           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2023 年末          | 2022 年末          | 2021 年末          |
| 基金份额累计净值增长率   | 18.87%           | 14.17%           | 11.50%           |

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。

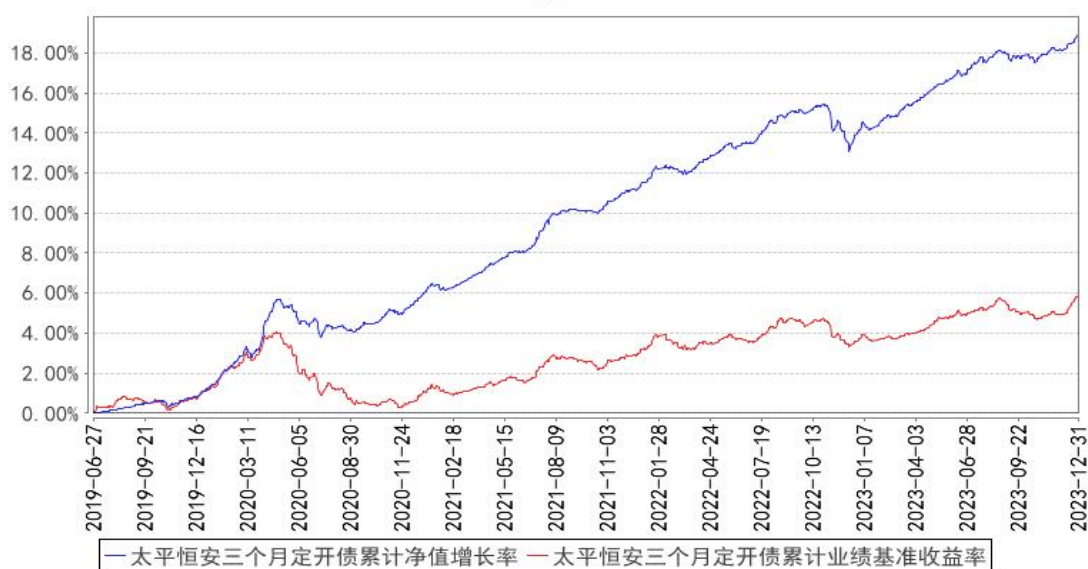
## 3.2 基金净值表现

### 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.84%    | 0.05%       | 0.82%      | 0.04%         | 0.02%  | 0.01% |
| 过去六个月      | 1.45%    | 0.05%       | 0.83%      | 0.04%         | 0.62%  | 0.01% |
| 过去一年       | 4.11%    | 0.05%       | 2.06%      | 0.04%         | 2.05%  | 0.01% |
| 过去三年       | 12.12%   | 0.05%       | 4.74%      | 0.05%         | 7.38%  | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.87%   | 0.06%       | 5.85%      | 0.06%         | 13.02% | 0.00% |

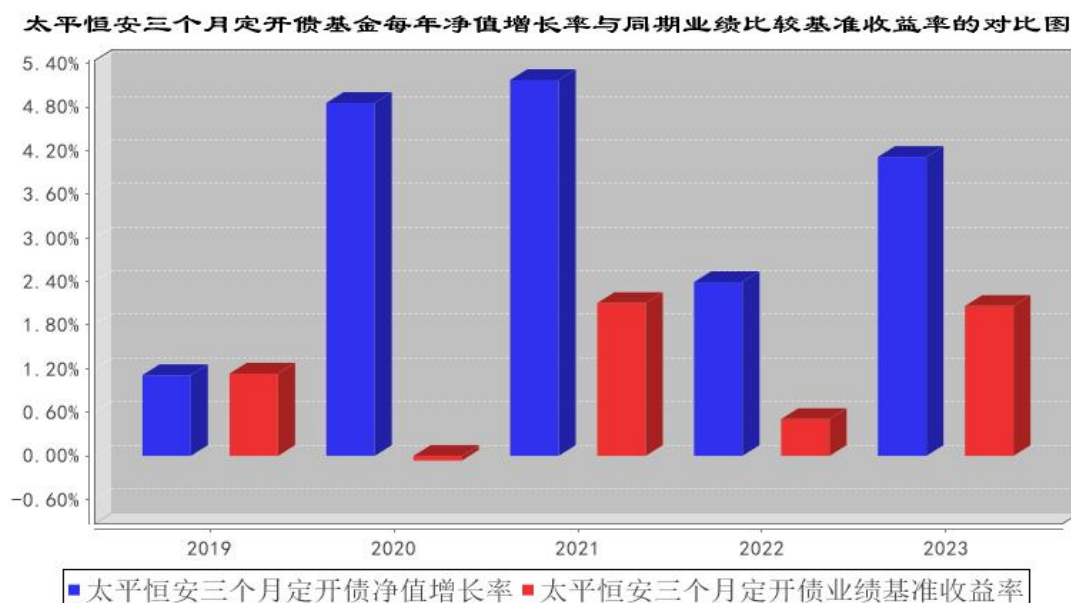
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

太平恒安三个月定开债累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2019 年 6 月 27 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。图示日期为 2019 年 6 月 27 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 6 月 27 日，至本报告期末未满 5 年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额     | 年度利润分配合计       | 备注 |
|--------|---------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 2023 年 | 0.5500        | 186,708,377.18 | 12,803,633.11 | 199,512,010.29 | -  |
| 2022 年 | 0.4000        | 114,699,350.62 | 8,594,020.95  | 123,293,371.57 | -  |
| 2021 年 | 0.6900        | 119,596,652.12 | 10,192,690.98 | 129,789,343.10 | -  |
| 合计     | 1.6400        | 421,004,379.92 | 31,590,345.04 | 452,594,724.96 | -  |

## § 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 35 只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务                   | 任本基金的基金经理（助理）期限  |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|----------------------|------------------|------|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                      | 任职日期             | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 吴超  | 固定收益投资部助理总监、本基金的基金经理 | 2019 年 6 月 27 日  | -    | 10 年   | 美国本特利商学院金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 5 月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公司担任部门经理、投资总监等职。2017 年 3 月加入本公司，现任固定收益投资部助理总监。2018 年 2 月 12 日至 2022 年 8 月 15 日任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2019 年 3 月 25 日起任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 27 日起任太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 28 日起任太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 7 日起任太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 12 日起任太平恒久纯债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 24 日起任太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 17 日起任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。 |
| 朱燕琼 | 本基金的基金经理             | 2023 年 3 月 27 日  | -    | 10 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。                                                                                                                                                                                                            |
| 张杰  | 本基金的基金经理助理           | 2022 年 10 月 19 日 | -    | 5 年    | 南开大学金融硕士，具有证券投资基金从业资格。2018 年 7 月起在华夏久盈资产管理有限责任公司从事宏观研究工作。2021                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                      |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 年 4 月加入本公司，从事宏观利率研究。2022 年 10 月 19 日起担任太平恒兴纯债债券型证券投资基金基金经理助理。2022 年 10 月 19 日起担任太平恒睿纯债债券型证券投资基金基金经理助理。2022 年 10 月 19 日起担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助理。 |
|--|--|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2023 年经济运行回升向好，GDP 同比增长 5.2%，圆满实现经济增长 5% 预期目标。扣除基数影响的 GDP 两年复合增速为 4.1%，对应中央经济工作会议所总结的“经济恢复发展的一年”，经济初步走出谷底但尚未完全修复潜在增长水平。2023 年年初市场对于经济复苏预期较高，但二季度后出现有效需求不足的问题，社会预期转弱。到三季度后随着数据表现持续不足预期，“宽信用”政策密集落地，稳地产政策不断加码、特殊再融资债、万亿特别国债发行、PSL 重启等修复市场对于经济偏弱预期。

债券市场 2023 年全年表现较好，上半年市场主线从“强预期”转向“弱修复”，下半年从“宽货币”转向“宽信用”再转向“资金面充裕”，利率债收益率曲线走势呈现“M”型，而信用债受益于特殊再融资债对城投债形成明显基本面支撑，整体信用利差压缩明显。

本报告期内，本基金保持相对积极的债券投资策略，全年维持较高的杠杆和相对久期，取得了较好的效果。全年投资品种主要以金融债套息策略为主，期间运用长久期利率债参与波段交易，有效增厚了组合超额收益。

### 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 4.11%，同期业绩比较基准收益率为 2.06%。

## 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 年中国经济面临一些积极的因素，如“稳增长”政策支持和新经济动能的推动，也有一些挑战，包括内外需压力、制造业疲软、地产下行等，整体预计维持继续向上修复的态势，处于弱复苏状态。另一方面，货币政策继续维持流动性供给充裕，以配合财政政策，共同促进经济增长，加之，全球经济下行压力下，高利率环境难以维持，中美经济周期错位得到缓解，外部对于国内货币政策的制约将下降。

2024 年债券市场在经济恢复需要持续支持、配合地方政府化债、汇率贬值压力也减轻的情况下，央行后续流动性投放保持积极的概率较大，如果资金水平未持续回落到偏松状态，后续降准降息或者其他货币政策工具有较大概率落地，当下多数债券期限利差均处于 2018 年以来最低水平，预计 2024 年曲线相对 2023 年会出现走陡。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。

在内控制度建设方面，公司持续完善内控制度建设，并时刻关注法规的新变化、结合行业发展的新动态、围绕业务开展的新需要，适时组织更新相关业务制度。在公司合规文化建设方面，公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，不断增强全体员工的合规自觉与风控意识，为公司业务的规范开展和健康发展创造良好的内控环境。在稽核检查方面，公司稽核风控部在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对各项业务活动进行监督、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，定期对各类业务开展情况以及公司整体运营情况进行覆盖全面、重点突出的检查、总结和反馈，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，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的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值和产品委员会成员由主席负责，估值分委会常任委员由稽核风控部、投资部门、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金》的约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%。本基金管理人在本报告期内实施三次分红，一次分红方案为：每 10 份基金发放红利 0.25 元，二次分红方案为：每 10 份基金发放红利 0.10 元，三次分红方案为：每 10 份基金发放红利 0.20 元。

4.9 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，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现（管理人公司名称）公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2024)第 26004 号 |

6.2 审计报告的基本内容

|         |                               |
|---------|-------------------------------|
| 审计报告标题  | 审计报告                          |
| 审计报告收件人 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计意见            | <p>我们审计了太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“太平恒安三个月定开债基金”）的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了太平恒安三个月定开债基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>                   |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于太平恒安三个月定开债基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                  |
| 强调事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 其他事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 其他信息            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>太平恒安三个月定开债基金的基金管理人太平基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估太平恒安三个月定开债基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算太平恒安三个月定开债基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督太平恒安三个月定开债基金的财务报告过程。</p>    |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能</p> |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | <p>涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对太平恒安三个月定开债基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致太平恒安三个月定开债基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |     |
| 注册会计师的姓名  | 陈熹                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 金诗涛 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |     |
| 审计报告日期    | 2024 年 3 月 27 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                         |                          |
| 货币资金     | 7.4.7.1 | 42,590,803.45           | 3,064,709.44             |
| 结算备付金    |         | 5,345,410.48            | 3,560,045.88             |
| 存出保证金    |         | 137,184.55              | 49,156.58                |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 6,680,019,126.54        | 4,924,864,831.45         |
| 其中：股票投资  |         | -                       | -                        |
| 基金投资     |         | -                       | -                        |
| 债券投资     |         | 6,680,019,126.54        | 4,924,864,831.45         |
| 资产支持证券投资 |         | -                       | -                        |

|               |            |                                 |                                  |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 贵金属投资         |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | 5,000,000.00                    | -                                |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                               | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 其他债权投资        | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 其他权益工具投资      | 7.4.7.7    | -                               | -                                |
| 应收清算款         |            | 4,533,151.34                    | -                                |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | -                               | -                                |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.8    | -                               | -                                |
| 资产总计          |            | 6,737,625,676.36                | 4,931,538,743.35                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2022 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        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | 2,298,485,675.73                | 1,747,778,695.82                 |
| 应付清算款         |            | 40,206,490.40                   | 76,723.20                        |
| 应付赎回款         |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 1,115,969.33                    | 821,088.90                       |
| 应付托管费         |            | 371,989.77                      | 273,696.29                       |
| 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          | 7.4.7.9    | 369,692.30                      | 231,439.13                       |
| 负债合计          |            | 2,340,549,817.53                | 1,749,181,643.34                 |
| <b>净资产：</b>   |            |                                 |                                  |
| 实收基金          | 7.4.7.10   | 4,328,664,943.56                | 3,090,749,914.03                 |
| 未分配利润         | 7.4.7.12   | 68,410,915.27                   | 91,607,185.98                    |
| 净资产合计         |            | 4,397,075,858.83                | 3,182,357,100.01                 |
| 负债和净资产总计      |            | 6,737,625,676.36                | 4,931,538,743.35                 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0158 元，基金份额总额 4,328,664,943.56 份。

## 7.2 利润表

会计主体：太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年<br>12 月 31 日 |
|----------------------------|------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |            | 179,469,462.22                            | 79,701,477.35                                  |
| 1. 利息收入                    |            | 831,483.74                                | 529,573.51                                     |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.13   | 197,989.21                                | 112,081.93                                     |
| 债券利息收入                     |            | -                                         | -                                              |
| 资产支持证券利<br>息收入             |            | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资<br>产收入             |            | 633,494.53                                | 417,491.58                                     |
| 其他利息收入                     |            | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”<br>填列）      |            | 141,827,198.70                            | 126,261,053.90                                 |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.14   | -                                         | -                                              |
| 基金投资收益                     |            | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.15   | 141,827,198.70                            | 126,261,053.90                                 |
| 资产支持证券投<br>资收益             | 7.4.7.16   | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.17   | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.18   | -                                         | -                                              |
| 股利收益                       | 7.4.7.19   | -                                         | -                                              |
| 其他投资收益                     |            | -                                         | -                                              |
| 3. 公允价值变动收益<br>（损失以“-”号填列） | 7.4.7.20   | 36,809,858.09                             | -47,089,153.98                                 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）     |            | -                                         | -                                              |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）     | 7.4.7.21   | 921.69                                    | 3.92                                           |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 36,585,577.13                             | 25,326,392.76                                  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 11,356,769.47                             | 8,596,543.64                                   |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -                                         | -                                              |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 3,785,589.84                              | 2,865,514.56                                   |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | -                                         | -                                              |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                                         | -                                              |
| 5. 利息支出                    |            | 21,230,896.09                             | 13,665,134.56                                  |
| 其中：卖出回购金融资<br>产支出          |            | 21,230,896.09                             | 13,665,134.56                                  |
| 6. 信用减值损失                  | 7.4.7.22   | -                                         | -                                              |

|                     |          |                |               |
|---------------------|----------|----------------|---------------|
| 7. 税金及附加            |          | 1,161.53       | -             |
| 8. 其他费用             | 7.4.7.23 | 211,160.20     | 199,200.00    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 142,883,885.09 | 54,375,084.59 |
| 减：所得税费用             |          | -              | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 142,883,885.09 | 54,375,084.59 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -              | -             |
| 六、综合收益总额            |          | 142,883,885.09 | 54,375,084.59 |

### 7.3 净资产变动表

会计主体：太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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                           | 3,090,749,914.03                       | -      | 91,607,185.98   | 3,182,357,100.01 |
| 二、本期期初净资产                           | 3,090,749,914.03                       | -      | 91,607,185.98   | 3,182,357,100.01 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | 1,237,915,029.53                       | -      | -23,196,270.71  | 1,214,718,758.82 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                      | -      | 142,883,885.09  | 142,883,885.09   |
| （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） | 1,237,915,029.53                       | -      | 33,431,854.49   | 1,271,346,884.02 |
| 其中：1. 基金申购款                         | 1,859,902,093.65                       | -      | 55,849,597.80   | 1,915,751,691.45 |
| 2. 基金赎回款                            | -621,987,064.12                        | -      | -22,417,743.31  | -644,404,807.43  |
| （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       | -                                      | -      | -199,512,010.29 | -199,512,010.29  |

|                                          |                                             |        |                 |                  |
|------------------------------------------|---------------------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| 产减少以“-”号填列)                              |                                             |        |                 |                  |
| 四、本期期末净资产                                | 4,328,664,943.56                            | -      | 68,410,915.27   | 4,397,075,858.83 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |        |                 |                  |
|                                          | 实收基金                                        | 其他综合收益 | 未分配利润           | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 2,309,541,105.22                            | -      | 103,988,439.24  | 2,413,529,544.46 |
| 二、本期期初净资产                                | 2,309,541,105.22                            | -      | 103,988,439.24  | 2,413,529,544.46 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 781,208,808.81                              | -      | -12,381,253.26  | 768,827,555.55   |
| (一)、综合收益总额                               | -                                           | -      | 54,375,084.59   | 54,375,084.59    |
| (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)      | 781,208,808.81                              | -      | 56,537,033.72   | 837,745,842.53   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 1,134,890,443.98                            | -      | 82,162,641.67   | 1,217,053,085.65 |
| 2. 基金赎回款                                 | -353,681,635.17                             | -      | -25,625,607.95  | -379,307,243.12  |
| (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) | -                                           | -      | -123,293,371.57 | -123,293,371.57  |
| 四、本期期末净资产                                | 3,090,749,914.03                            | -      | 91,607,185.98   | 3,182,357,100.01 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

曹琦

邓先虎

王瑞瑾

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金(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[2019]946号《关于准予太平恒安三个月定期开放债券型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《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,001,006.99元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0381号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2019年6月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,002,007.22份,其中认购资金利息折合1,000.23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,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、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固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,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%,但在每次开放期前15个工作日、开放期内及开放期结束后15个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制;在开放期内,本基金持有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%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人太平基金管理有限公司于2024年3月27日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1)赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2)该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3)该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损

益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务

的指导意见》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券及可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券及可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于 2024 年颁布的修订后的《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〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 42,590,803.45           | 3,064,709.44             |
| 等于：本金          | 42,585,748.54           | 3,063,930.05             |
| 加：应计利息         | 5,054.91                | 779.39                   |
| 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             | 42,590,803.45           | 3,064,709.44             |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2023 年 12 月 31 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                    | 1,764,687,916.51 | 24,926,105.72  | 1,785,874,036.50 | -3,739,985.73  |
|               | 银行间市场                    | 4,810,103,024.62 | 79,486,790.04  | 4,894,145,090.04 | 4,555,275.38   |
|               | 合计                       | 6,574,790,941.13 | 104,412,895.76 | 6,680,019,126.54 | 815,289.65     |
| 资产支持证券        |                          | -                | -              | -                | -              |
| 基金            |                          | -                | -              | -                | -              |
| 其他            |                          | -                | -              | -                | -              |
| 合计            |                          | 6,574,790,941.13 | 104,412,895.76 | 6,680,019,126.54 | 815,289.65     |
| 项目            | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 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                    | 1,149,803,418.25 | 6,415,600.27   | 1,151,861,493.63 | -4,357,524.89  |
|               | 银行间市场                    | 3,756,001,943.55 | 48,638,437.82  | 3,773,003,337.82 | -31,637,043.55 |
|               | 合计                       | 4,905,805,361.80 | 55,054,038.09  | 4,924,864,831.45 | -35,994,568.44 |
| 资产支持证券        |                          | -                | -              | -                | -              |
| 基金            |                          | -                | -              | -                | -              |
| 其他            |                          | -                | -              | -                | -              |
| 合计            |                          | 4,905,805,361.80 | 55,054,038.09  | 4,924,864,831.45 | -35,994,568.44 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|
|----|-------------------------|

|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
|-------|--------------------------|-----------|
| 交易所市场 | 5,000,000.00             | —         |
| 银行间市场 | —                        | —         |
| 合计    | 5,000,000.00             | —         |
| 项目    | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | —                        | —         |
| 银行间市场 | —                        | —         |
| 合计    | —                        | —         |

#### 7.4.7.4.2 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及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.4.3 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及上年度末均未计提减值准备。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末及上年度末均未计提债权投资减值准备。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末及上年度末均未计提其他债权投资减值准备。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具。

#### 7.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 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      | 75,692.30               | 69,439.13                |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 75,692.30               | 69,439.13                |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提信息披露费     | 240,000.00              | 120,000.00               |
| 预提审计费       | 54,000.00               | 42,000.00                |
| 合计          | 369,692.30              | 231,439.13               |

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|----------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额             |
| 上年度末          | 3,090,749,914.03                       | 3,090,749,914.03 |
| 本期申购          | 1,859,902,093.65                       | 1,859,902,093.65 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -621,987,064.12                        | -621,987,064.12  |
| 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           | 4,328,664,943.56                       | 4,328,664,943.56 |

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 118,666,063.89 | -27,058,877.91 | 91,607,185.98  |
| 本期期初           | 118,666,063.89 | -27,058,877.91 | 91,607,185.98  |
| 本期利润           | 106,074,027.00 | 36,809,858.09  | 142,883,885.09 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 21,550,158.21  | 11,881,696.28  | 33,431,854.49  |
| 其中：基金申购款       | 44,076,071.90  | 11,773,525.90  | 55,849,597.80  |

|         |                 |               |                 |
|---------|-----------------|---------------|-----------------|
| 基金赎回款   | -22,525,913.69  | 108,170.38    | -22,417,743.31  |
| 本期已分配利润 | -199,512,010.29 | -             | -199,512,010.29 |
| 本期末     | 46,778,238.81   | 21,632,676.46 | 68,410,915.27   |

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 101,796.55                             | 87,843.95                                   |
| 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 | 93,050.91                              | 23,588.64                                   |
| 其他        | 3,141.75                               | 649.34                                      |
| 合计        | 197,989.21                             | 112,081.93                                  |

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-买卖股票差价收入。

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 150,816,170.43              | 122,069,324.11                   |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -8,988,971.73               | 4,191,729.79                     |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                           | -                                |
| 债券投资收益——申购                   | -                           | -                                |

|       |                |                |
|-------|----------------|----------------|
| 购差价收入 |                |                |
| 合计    | 141,827,198.70 | 126,261,053.90 |

#### 7.4.7.15.2 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>2023年1月1日至2023年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年12月<br>31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 8,729,039,717.47                | 6,464,240,814.66                     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 8,616,983,369.64                | 6,384,966,929.31                     |
| 减：应计利息总额               | 120,942,047.06                  | 74,996,313.95                        |
| 减：交易费用                 | 103,272.50                      | 85,841.61                            |
| 买卖债券差价收入               | -8,988,971.73                   | 4,191,729.79                         |

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

#### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 36,809,858.09                             | -47,089,153.98                                 |
| 股票投资                       | -                                         | -                                              |
| 债券投资                       | 36,809,858.09                             | -47,089,153.98                                 |
| 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<br>变动产生的预估增值税 | -                                         | -                                              |
| 合计                         | 36,809,858.09                             | -47,089,153.98                                 |

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 921.69                                    | 3.92                                           |
| 合计      | 921.69                                    | 3.92                                           |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31<br>日 |
|---------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 审计费用    | 54,000.00                                 | 42,000.00                                      |
| 信息披露费   | 120,000.00                                | 120,000.00                                     |
| 证券出借违约金 | -                                         | -                                              |

|       |            |            |
|-------|------------|------------|
| 账户维护费 | 36,480.00  | 37,200.00  |
| 其他    | 80.20      | -          |
| 咨询服务费 | 600.00     | -          |
| 合计    | 211,160.20 | 199,200.00 |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 江苏银行股份有限公司（“江苏银行”） | 基金托管人               |
| 太平资产管理有限公司（“太平资管”） | 基金管理人的股东            |
| 太平人寿保险有限公司（“太平人寿”） | 基金管理人的股东            |
| 安石投资管理有限公司（“安石投资”） | 基金管理人的股东            |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金在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。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金在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。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在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。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金在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。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----|----------------------------------------|---------------------------------------------|
|----|----------------------------------------|---------------------------------------------|

|                  | 月 31 日        | 12 月 31 日    |
|------------------|---------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 11,356,769.47 | 8,596,543.64 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 158,810.98    | 522,854.66   |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 11,197,958.49 | 8,073,688.98 |

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

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,785,589.84                           | 2,865,514.56                                |

注：支付基金托管行江苏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：

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

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----|----------------------------------------|---------------------------------------------|
|----|----------------------------------------|---------------------------------------------|

|                                 |               |   |
|---------------------------------|---------------|---|
| 基金合同生效日（2019 年 6 月 27 日）持有的基金份额 | —             | — |
| 报告期初持有的基金份额                     | —             | — |
| 报告期内申购/买入总份额                    | 39,082,316.57 | — |
| 报告期内因拆分变动份额                     | —             | — |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额                  | —             | — |
| 报告期末持有的基金份额                     | 39,082,316.57 | — |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 0.9029%       | — |

#### 7.4.10.5.2 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>2023 年 12 月 31 日 |                             | 上年度末<br>2022 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（%） |
| 江苏银行  | 1,888,786,145.12        | 43.6344                     | 1,592,591,579.61         | 51.5277                     |
| 太平人寿  | 1,571,562,571.58        | 36.3059                     | 892,025,893.66           | 28.8611                     |

#### 7.4.10.6 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>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |           |
|-------|----------------------------------------|------------|---------------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                                   | 当期利息收入     | 期末余额                                        | 当期利息收入    |
| 江苏银行  | 42,590,803.45                          | 101,796.55 | 3,064,709.44                                | 87,843.95 |

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记<br>日 | 除息日 |    | 每 10<br>份基金<br>份额分<br>红数 | 现金形式<br>发放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配合<br>计 | 备注 |
|----|---------------|-----|----|--------------------------|--------------|---------------|--------------|----|
|    |               | 场内  | 场外 |                          |              |               |              |    |

|    |                          |   |                          |        |                |               |                |   |
|----|--------------------------|---|--------------------------|--------|----------------|---------------|----------------|---|
| 1  | 2023<br>年 3<br>月 29<br>日 | - | 2023<br>年 3<br>月 29<br>日 | 0.2500 | 75,758,169.42  | 4,359,979.15  | 80,118,148.57  | - |
| 2  | 2023<br>年 5<br>月 18<br>日 | - | 2023<br>年 5<br>月 18<br>日 | 0.1000 | 30,302,643.29  | 1,787,528.82  | 32,090,172.11  | - |
| 3  | 2023<br>年 9<br>月 27<br>日 | - | 2023<br>年 9<br>月 27<br>日 | 0.2000 | 80,647,564.47  | 6,656,125.14  | 87,303,689.61  | - |
| 合计 | -                        | - | -                        | 0.5500 | 186,708,377.18 | 12,803,633.11 | 199,512,010.29 | - |

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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 1,594,747,802.97 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           |
|-----------|------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 092318003 | 23 农发清发 03 | 2024 年 1 月 2 日 | 101.25 | 2,660,000  | 269,335,247.54   |
| 170210    | 17 国开 10   | 2024 年 1 月 2 日 | 107.97 | 1,000,000  | 107,966,174.86   |
| 200307    | 20 进出 07   | 2024 年 1 月 2 日 | 105.32 | 1,900,000  | 200,103,627.39   |
| 220402    | 22 农发 02   | 2024 年 1 月 2 日 | 103.33 | 6,743,000  | 696,768,599.70   |
| 092318003 | 23 农发清发 03 | 2024 年 1 月 3 日 | 101.25 | 1,070,000  | 108,341,622.13   |
| 220402    | 22 农发 02   | 2024 年 1 月 3 日 | 103.33 | 3,410,000  | 352,362,587.12   |
| 合计        |            |                |        | 16,783,000 | 1,734,877,858.74 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 703,737,872.76 元, 截至 2024 年 1 月 2 日-2024 年 5 月 3 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2023 年 12 月 31 日, 本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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內。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | -                       | 50,240,901.37            |
| 合计     | -                       | 50,240,901.37            |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 127,995,016.98          | 177,423,000.57           |
| 合计     | 127,995,016.98          | 177,423,000.57           |

#### 7.4.13.2.3 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<br>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 4,268,360,991.13        | 4,281,214,331.50         |
| AAA 以下 | 31,062,475.41           | 51,150,877.81            |
| 未评级    | 2,252,600,643.02        | 364,835,720.20           |
| 合计     | 6,552,024,109.56        | 4,697,200,929.51         |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、长期未评级债券为国债、政策性金融债、地方政府债。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，本基金的卖出回购金融资产款(若有)计息且利息金额不重大；除此之外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

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

基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本年度末，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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内            | 1-5 年            | 5 年以上         | 不计息          | 合计               |
|----------------------------|------------------|------------------|---------------|--------------|------------------|
| 资产                         |                  |                  |               |              |                  |
| 货币资金                       | 42,590,803.45    | -                | -             | -            | 42,590,803.45    |
| 结算备付金                      | 5,345,410.48     | -                | -             | -            | 5,345,410.48     |
| 存出保证金                      | 137,184.55       | -                | -             | -            | 137,184.55       |
| 交易性金融资产                    | 1,872,686,184.62 | 4,742,667,687.05 | 64,665,254.87 | -            | 6,680,019,126.54 |
| 买入返售金融资产                   | 5,000,000.00     | -                | -             | -            | 5,000,000.00     |
| 应收清算款                      | -                | -                | -             | 4,533,151.34 | 4,533,151.34     |

|                          |                  |                  |                  |                |                  |
|--------------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|------------------|
| 资产总计                     | 1,925,759,583.10 | 4,742,667,687.05 | 64,665,254.87    | 4,533,151.34   | 6,737,625,676.36 |
| 负债                       |                  |                  |                  |                |                  |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                | -                | 1,115,969.33   | 1,115,969.33     |
| 应付托管费                    | -                | -                | -                | 371,989.77     | 371,989.77       |
| 应付清算款                    | -                | -                | -                | 40,206,490.40  | 40,206,490.40    |
| 卖出回购金融资产款                | 2,298,485,675.73 | -                | -                | -              | 2,298,485,675.73 |
| 其他负债                     | -                | -                | -                | 369,692.30     | 369,692.30       |
| 负债总计                     | 2,298,485,675.73 | -                | -                | 42,064,141.80  | 2,340,549,817.53 |
| 利率敏感度缺口                  | -372,726,092.63  | 4,742,667,687.05 | 64,665,254.87    | -37,530,990.46 | 4,397,075,858.83 |
| 上年度末<br>2022 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                     | 3,064,709.44     | -                | -                | -              | 3,064,709.44     |
| 结算备付金                    | 3,560,045.88     | -                | -                | -              | 3,560,045.88     |
| 存出保证金                    | 49,156.58        | -                | -                | -              | 49,156.58        |
| 交易性金融资产                  | 1,135,461,986.88 | 1,430,708,682.25 | 2,358,694,162.32 | -              | 4,924,864,831.45 |
| 资产总计                     | 1,142,135,898.78 | 1,430,708,682.25 | 2,358,694,162.32 | -              | 4,931,538,743.35 |
| 负债                       |                  |                  |                  |                |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 1,747,778,695.82 | -                | -                | -              | 1,747,778,695.82 |
| 应付清算款                    | -                | -                | -                | 76,723.20      | 76,723.20        |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                | -                | 821,088.90     | 821,088.90       |
| 应付托管费                    | -                | -                | -                | 273,696.29     | 273,696.29       |
| 其他负债                     | -                | -                | -                | 231,439.13     | 231,439.13       |
| 负债总计                     | 1,747,778,695.82 | -                | -                | 1,402,947.52   | 1,749,181,643.34 |
| 利率敏感度缺口                  | -605,642,797.04  | 1,430,708,682.25 | 2,358,694,162.32 | -1,402,947.52  | 3,182,357,100.01 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2023 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 市场利率上升 25 个基点 | -52,567,127.48 | -48,642,341.37 |
| 市场利率下降 25 个基点 | 53,367,475.55  | 49,513,696.74  |

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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，本基金未持有的交易性权益类投资，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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>2023 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 6,680,019,126.54        | 4,924,864,831.45         |
| 第三层次          | -                       | -                        |

|    |                  |                  |
|----|------------------|------------------|
| 合计 | 6,680,019,126.54 | 4,924,864,831.45 |
|----|------------------|------------------|

#### 7.4.14.2.2 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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未持有第三层次公允价值资产。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上期末：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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            | 6,680,019,126.54 | 99.15         |
|    | 其中：债券             | 6,680,019,126.54 | 99.15         |
|    | 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          | 5,000,000.00     | 0.07          |
|    | 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      | 47,936,213.93    | 0.71          |
| 8  | 其他各项资产            | 4,670,335.89     | 0.07          |
| 9  | 合计                | 6,737,625,676.36 | 100.00        |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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。

### 8.2.2 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。

## 8.3 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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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。

### 8.4.2 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。

### 8.4.3 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。

## 8.5 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      | 10,719,188.25    | 0.24         |
| 2  | 央行票据      | —                | —            |
| 3  | 金融债券      | 3,439,446,412.87 | 78.22        |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,241,711,079.54 | 50.98        |
| 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      | 127,995,016.98   | 2.91         |
| 9  | 其他        | 3,101,858,508.44 | 70.54        |
| 10 | 合计        | 6,680,019,126.54 | 151.92       |

## 8.6 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  | 220402    | 22 农发 02   | 10,400,000 | 1,074,654,224.66 | 24.44        |
| 2  | 092318003 | 23 农发清发 03 | 3,900,000  | 394,890,024.59   | 8.98         |
| 3  | 170210    | 17 国开 10   | 2,700,000  | 291,508,672.13   | 6.63         |
| 4  | 2020022   | 20 南京银行    | 2,600,000  | 268,337,986.89   | 6.10         |

|   |        |          |           |                |      |
|---|--------|----------|-----------|----------------|------|
|   |        | 二级 01    |           |                |      |
| 5 | 200307 | 20 进出 07 | 2,100,000 | 221,167,167.12 | 5.03 |

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 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，上海银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、平安银行股份有限公司、南京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。

#### 8.11.2 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

本基金不投资于股票资产。

#### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 137,184.55   |
| 2  | 应收清算款 | 4,533,151.34 |
| 3  | 应收股利  | —            |
| 4  | 应收利息  | —            |
| 5  | 应收申购款 | —            |
| 6  | 其他应收款 | —            |
| 7  | 待摊费用  | —            |
| 8  | 其他    | —            |
| 9  | 合计    | 4,670,335.89 |

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 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。

#### 8.11.6 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。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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<br>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<br>例 (%) | 持有份额         | 占总份额比<br>例 (%) |
| 602          | 7,190,473.33  | 4,323,251,702.50 | 99.8749        | 5,413,241.06 | 0.1251         |

#### 9.2 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 | 544,224.84 | 0.0126       |

#### 9.3 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                | -                  |

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2019 年 6 月 27 日) 基金份额总额 | 200,002,007.22   |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 3,090,749,914.03 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 1,859,902,093.65 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 621,987,064.12   |
| 本报告期基金拆分变动份额                     | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 4,328,664,943.56 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

(1) 本基金管理人于 2023 年 6 月 17 日发布公告，自 2023 年 6 月 16 日起董晓亮先生不再担任公司副总经理职务。

(2) 本基金管理人于 2023 年 8 月 12 日发布公告，自 2023 年 8 月 11 日起范宇先生不再担任公司总经理、首席信息官职务；邓先虎先生代为履行公司总经理、首席信息官职务；陈晓女士担任公司助理总经理。

(3) 本基金管理人于 2023 年 11 月 18 日发布公告，自 2023 年 11 月 16 日起曹琦女士担任公司总经理；陈新先生担任公司首席信息官；邓先虎先生不再代为履行公司总经理、首席信息官职务。

#### 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，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

经过邀请招标，并履行适当程序，聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计机构。本基金本年度应支付审计费伍万肆仟元整。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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，本公司及高级管理人员未受到稽查或处罚等。

#### 11.6.2 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，托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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 (%) |    |
| 华泰证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

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) 市场形象及财务状况良好。
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (3) 内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (4) 研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

根据上述标准进行考察后，由基金管理人的投资决策委员会确定租用券商的交易单元，并由基金管理人与被选择的券商签订协议。

#### 2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本报告期内，基金租用证券公司交易单元无变化。

### 11.7.2 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 (%) |
| 华泰证券 | 3,157,209,132.70 | 100.00           | 10,497,660,000.00 | 100.00             | -    | -                |

## 11.8 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  | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 2022 年第四季度报告       | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 2  | 关于太平恒安三个月定期开放债券型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 | 2023 年 2 月 25 日 |

|    |                                                |           |                 |
|----|------------------------------------------------|-----------|-----------------|
| 3  | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金恢复向个人投资者开放申购、转换转入的公告       | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 3 月 16 日 |
| 4  | 关于太平恒安三个月定期开放债券型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 | 2023 年 3 月 21 日 |
| 5  | 太平基金管理有限公司关于太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金分红公告           | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 3 月 28 日 |
| 6  | 太平基金管理有限公司关于增聘朱燕琼担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的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 3 月 29 日 |
| 7  | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告                   | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 3 月 29 日 |
| 8  | 太平恒安三个月定期开放债券型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 | 2023 年 3 月 30 日 |
| 9  | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 2022 年年度报告                | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 3 月 30 日 |
| 10 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 1 号）     | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 3 月 30 日 |
| 11 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 2 号）     | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 4 月 20 日 |
| 12 | 太平恒安三个月定期开放债券型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 | 2023 年 4 月 20 日 |
| 13 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第一季度报告              | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 4 月 21 日 |
| 14 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金分红公告                       | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 5 月 17 日 |
| 15 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加上海挖财基金销售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 | 2023 年 5 月 31 日 |
| 16 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加上海攀赢基金销售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 | 2023 年 5 月 31 日 |
| 17 | 关于太平恒安三个月定期开放债券型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 | 2023 年 6 月 21 日 |
| 18 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加泛华普益基金销售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 | 2023 年 7 月 17 日 |
| 19 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司               | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 7 月 17 日 |

|    |                                                |           |                  |
|----|------------------------------------------------|-----------|------------------|
|    | 为销售机构并参加其费率优惠的公告                               |           |                  |
| 20 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第二季度报告              | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 7 月 21 日  |
| 21 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加平安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 | 2023 年 8 月 10 日  |
| 22 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年中期报告                | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 8 月 31 日  |
| 23 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金分红公告                       | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 9 月 26 日  |
| 24 | 关于太平恒安三个月定期开放债券型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 | 2023 年 10 月 20 日 |
| 25 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第三季度报告              | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 10 月 25 日 |
| 26 | 关于太平恒安三个月定期开放债券型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 | 2023 年 10 月 26 日 |
| 27 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加博时财富基金销售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 | 2023 年 12 月 5 日  |
| 28 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告                    | 中国证监会规定媒介 | 2023 年 12 月 29 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 20230101-20231231       | 892,025,893.66   | 679,536,677.92 | -              | 1,571,562,571.58 | 36.3059 |
| 机构    | 2              | 20230101-20231231       | 1,592,591,579.61 | 774,296,497.05 | 478,101,931.54 | 1,888,786,145.12 | 43.6344 |

#### 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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、《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平恒安三个月定期开放债券型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

### 13.2 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)

### 13.3 查阅方式

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

客户服务电话:400-028-8699、021-61560999

公司网址: [www.taipingfund.com.cn](http://www.taipingfund.com.cn)

太平基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日