

太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资  
基金  
2024 年年度报告

2024 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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 27 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 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日。

1.2 目录

|                                               |    |
|-----------------------------------------------|----|
| § 1 重要提示及目录 .....                             | 2  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2  |
| 1.2 目录 .....                                  | 3  |
| § 2 基金简介 .....                                | 5  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6  |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....                | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....                       | 9  |
| § 4 管理人报告 .....                               | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 10 |
| 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 |
| § 5 托管人报告 .....                               | 14 |
| 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 |
| § 6 审计报告 .....                                | 14 |
| 6.1 审计报告基本信息 .....                            | 14 |
| 6.2 审计报告的基本内容 .....                           | 14 |
| § 7 年度财务报表 .....                              | 16 |
| 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 |
| § 8 投资组合报告 .....                              | 45 |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 .....    | 47        |
| 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>49</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 .....           | 50        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 50        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 50        |
| 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 .....         | 50        |
| 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 .....                           | 51        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>53</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 .....    | 53        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 53        |
| <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 .....                             | 54        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 54        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                 |                      |              |
|-----------------|----------------------|--------------|
| 基金名称            | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金 |              |
| 基金简称            | 太平恒泰三个月定开债           |              |
| 基金主代码           | 018100               |              |
| 基金运作方式          | 契约型定期开放式             |              |
| 基金合同生效日         | 2023 年 6 月 7 日       |              |
| 基金管理人           | 太平基金管理有限公司           |              |
| 基金托管人           | 浙商银行股份有限公司           |              |
| 报告期末基金份额总额      | 3,897,680,323.71 份   |              |
| 基金合同存续期         | 不定期                  |              |
| 下属分级基金的基金简称     | 太平恒泰三个月定开债 A         | 太平恒泰三个月定开债 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 018100               | 020596       |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 3,897,680,323.71 份   | 一份           |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                         |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。                                                                                                         |
| 投资策略   | 本基金依据对宏观经济走势的分析，综合考虑各子类资产的特征以及市场整体流动性情况，采取定量模型与定性分析结合的模式，在各子类资产进行动态配置与调整。综合运用利率预期策略、久期选择策略、骑乘策略、基于信用资质变化的策略、基于供给变化的策略、资产支持证券投资策略、开放期投资策略等，力争实现基金资产的稳健增值 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率                                                                                                                                             |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，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                 | 浙商银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 赵霖                         | 林彬                   |
|         | 联系电话 | 021-38556613               | 0571-88269636        |
|         | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn | zsyhzctgb@czbank.com |
| 客户服务电话  |      | 021-61560999/400-028-8699  | 95527                |
| 传真      |      | 021-38556677               | 0571-88268688        |
| 注册地址    |      | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室  | 杭州市萧山区鸿宁路 1788 号     |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区银城中路 488 号          | 杭州市拱墅区环城西路 76 号      |

|       |                     |        |
|-------|---------------------|--------|
|       | 太平金融大厦 7 楼、5 楼 503A |        |
| 邮政编码  | 200120              | 310006 |
| 法定代表人 | 刘冬                  | 陆建强    |

2.4 信息披露方式

|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                     |
| 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 | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) | 北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层    |
| 注册登记机构 | 太平基金管理有限公司          | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 |

§ 3 主要财务指标、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 | 2024 年          | 2024 年 1 月 17 日<br>-2024 年 12 月 31 日 | 2023 年 6 月 7 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日 |                      |
|---------------|-----------------|--------------------------------------|------------------------------------------|----------------------|
|               | 太平恒泰三个月定开债<br>A | 太平恒泰三个月<br>定开债 C                     | 太平恒泰三个月定开<br>债 A                         | 太平恒泰<br>三个月定<br>开债 C |
| 本期已实现收益       | 38,707,007.61   | 125,552.92                           | 15,487,525.89                            | -                    |
| 本期利润          | 49,238,053.03   | 289,473.15                           | 17,169,778.39                            | -                    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0596          | 0.0378                               | 0.0142                                   | -                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 5.78%           | 3.73%                                | 1.41%                                    | -                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.93%           | 4.39%                                | 1.42%                                    | -                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024 年末         |                                      | 2023 年末                                  |                      |
| 期末可供分配利润      | 157,324,385.91  | -                                    | 11,290,995.99                            | -                    |
| 期末可供分         | 0.0404          | -                                    | 0.0128                                   | -                    |

|              |                  |        |                |   |
|--------------|------------------|--------|----------------|---|
| 配基金份额利润      |                  |        |                |   |
| 期末基金资产净值     | 4,068,615,663.41 | -      | 897,613,987.56 | - |
| 期末基金份额净值     | 1.0439           | 1.0439 | 1.0142         | - |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2024 年末          |        | 2023 年末        |   |
| 基金份额累计净值增长率  | 6.42%            | 4.39%  | 1.42%          | - |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、自 2024 年 01 月 17 日起对本基金增加 C 类基金份额。

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

太平恒泰三个月定开债 A

| 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      | 2.01%    | 0.07%       | 2.23%      | 0.09%         | -0.22% | -0.02% |
| 过去六个月      | 2.56%    | 0.07%       | 2.50%      | 0.10%         | 0.06%  | -0.03% |
| 过去一年       | 4.93%    | 0.06%       | 4.98%      | 0.09%         | -0.05% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.42%    | 0.06%       | 5.98%      | 0.07%         | 0.44%  | -0.01% |

太平恒泰三个月定开债 C

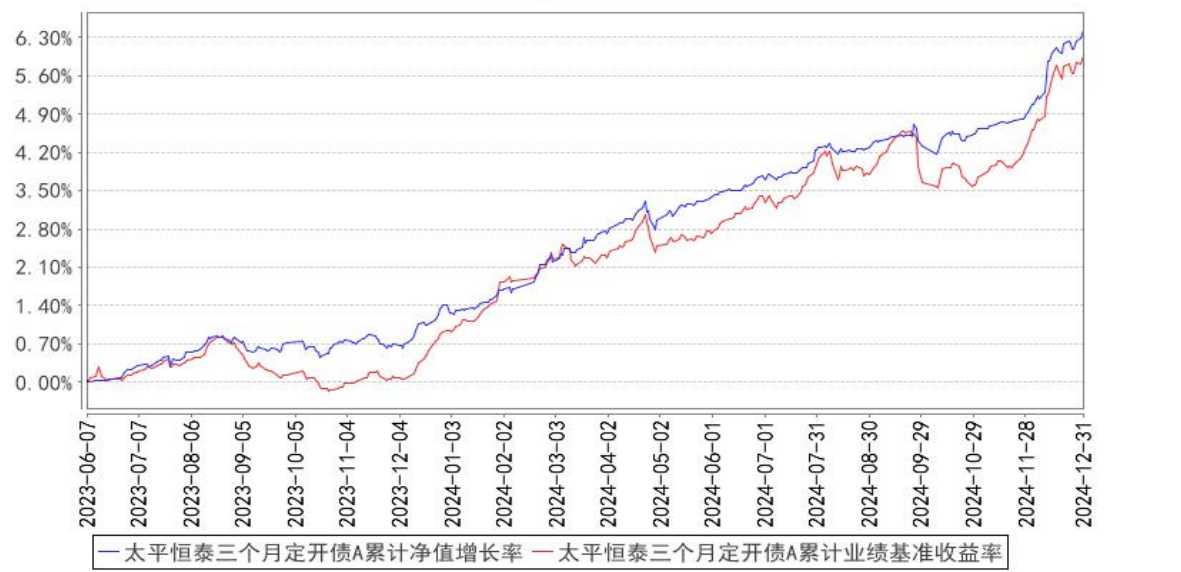
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 2.01%    | 0.07%       | 2.23%      | 0.09%         | -0.22% | -0.02% |

|                |       |       |       |       |        |       |
|----------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去六个月          | 0.60% | 0.19% | 2.50% | 0.10% | -1.90% | 0.09% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 4.39% | 0.17% | 4.81% | 0.09% | -0.42% | 0.08% |

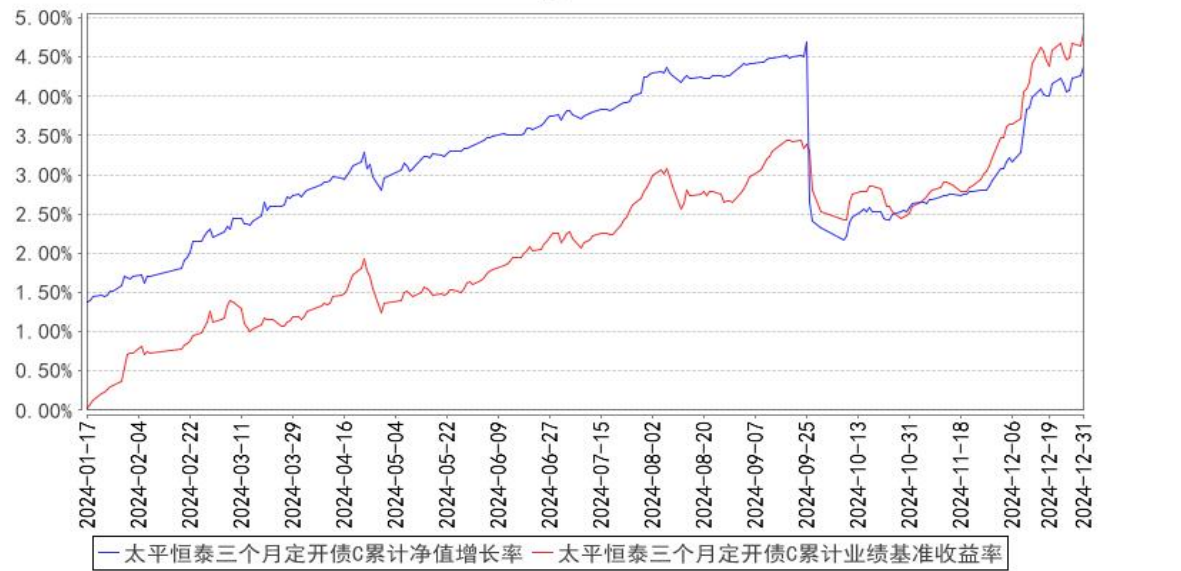
注：2024 年 1 月 17 日新增太平恒泰三个月定开债 C。

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

太平恒泰三个月定开债A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



太平恒泰三个月定开债C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



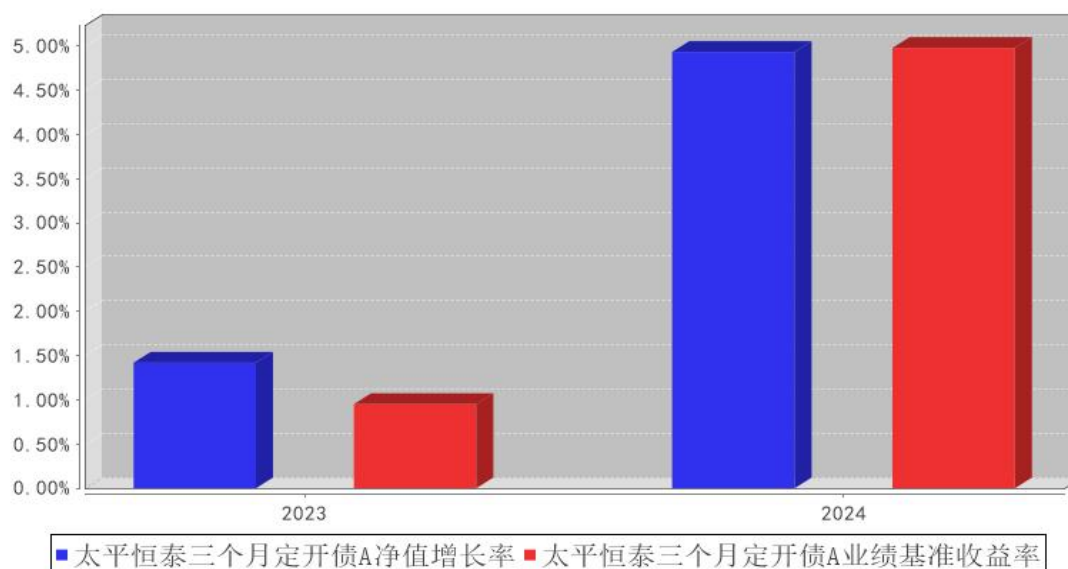
注：本基金基金合同生效日为 2023 年 6 月 7 日，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。太平恒泰三个月定开债 A 图示日期为 2023 年 6 月 7 日至 2024 年 12 月 31 日，太平恒泰三个月定开债 C 图示日期为 2024 年 1 月 17 日至 2024 年 12 月 31

日。

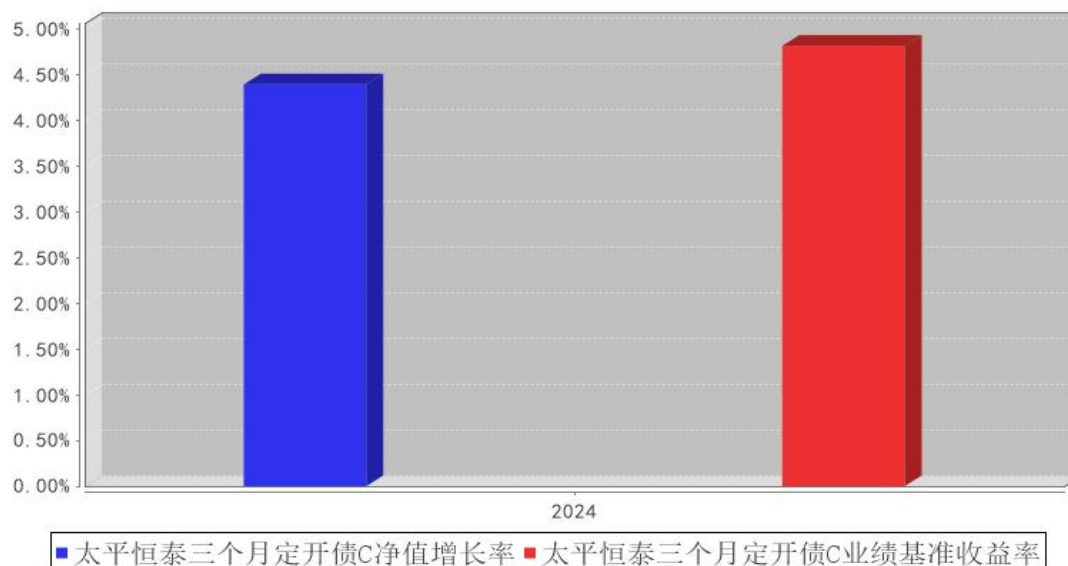
2024 年 1 月 17 日新增太平恒泰三个月定开债 C。

### 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

太平恒泰三个月定开债A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



太平恒泰三个月定开债C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



- 注：1、太平恒泰三个月定开债 A 基金合同生效日为 2023 年 6 月 7 日，至本报告期末未满 5 年。
- 2、太平恒泰三个月定开债 C 基金合同生效日为 2024 年 1 月 17 日，至本报告期末未满 5 年。
- 3、合同生效按当年实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

太平恒泰三个月定开债 A

| 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 |
|--------|---------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 2024 年 | 0.2000        | 15,879,956.83 | 71.84     | 15,880,028.67 | —  |
| 2023 年 | 0.0000        | 0.00          | 0.00      | 0.00          | —  |
| 2022 年 | 0.0000        | 0.00          | 0.00      | 0.00          | —  |
| 合计     | 0.2000        | 15,879,956.83 | 71.84     | 15,880,028.67 | —  |

§ 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 41 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 赵岩 | 固定收益投资部助理总监、本基金的基金经理 | 2023 年 6 月 7 日  | —    | 12 年   | 华东理工大学经济学学士，具有证券投资基金从业资格。2008 年 7 月起曾先后任职于招商银行信用卡中心、上海中财期货有限公司。2012 年 6 月起任上海银叶投资有限公司投资助理、投资经理等职。2016 年 6 月加入本公司，担任投资经理、专户投资部助理总监等职，现任固定收益投资部助理总监。2020 年 10 月 29 日至 2023 年 7 月 13 日担任太平恒睿纯债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 1 月 20 日起担任太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 8 日起担任太平恒兴 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 纯债债券型证券投资基金基金经理。2022 年 11 月 17 日起担任太平恒信 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022 年 12 月 9 日起担任太平绿色纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 1 月 18 日至 2024 年 4 月 10 日担任太平中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。2023 年 6 月 7 日起担任太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2024 年 6 月 6 日起担任太平恒发三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2024 年 12 月 10 日起担任太平恒庆利率债债券型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、基金经理的任职日期、离任日期一般情况下根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定；

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

在内控制度方面，公司根据相关法律法规制订了规范的投资管理制度和公平交易管理制度，以确保公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，研究团队为公司所有投资组合提供平等、公平的研究支持，所有投资组合共享公司统一的投资研究平台；严格实行各类资产管理业务之间的业务隔离和人员隔离制度，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，各投资组合的持仓及交易信息等均有效隔离。在交易执行方面，实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，保证交易在各投资组合间的公正实施。在监控和稽核方面，交易部门在交易执行过程中对公平交易实施一线监控与报告，稽核风控部对投资交易行为进行持续监督和评估，定期进行公平交易的分析工作，每季度和每年度对不同投资组合的收益率差异以及同向交易和反向交易情况进行分析，加强对公平交易过程和结果的监督。

### 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 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

### 4.3.3 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

2024 年债券市场收益率整体下行。具体看，行情大致分为三个阶段：1) 1 月初至 3 月初，在资金偏紧约束解除、基本面延续弱势、稳增长预期消退、货币宽松预期抬升等诸多利好因素的共同支撑下，债券收益率快速下行，超长债表现尤其亮眼；2) 3 月至 11 月，央行关注长债是利空，基本面仍未修复是利多因素，利多与利空的交织影响下，债券整体表现为宽幅震荡；3) 12 月债券收益率迎来快速大幅的下行，主因货币政策基调转为“适度宽松”，市场预期央行货币政策会出现明显宽松，带动收益率明显下行。

2024 年产品操作：产品以利率债和商金债策略为主，整体操作较为积极，灵活调整久期和杠杆，根据期限利差和信用利差优化组合持仓结构，阶段性参与中长期利率债交易，波段操作增厚收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平恒泰三个月定开债 A 的份额净值增长率为 4.93%，同期业绩比较基准收益率为 4.98%；太平恒泰三个月定开债 C 的份额净值增长率为 4.39%，同期业绩比较基准收益率为 4.81%；

## 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 9 月底密集出台一系列稳增长政策，带动四季度经济阶段性企稳，但地产销售脉冲一

般持续 3 个月，地产受制于居民收入和预期，基建受制于政府债务约束，出口下行压力也在一季度逐渐显现，整体经济内生动能恢复缓慢，对债券市场仍偏利多；在当前的基本面缓解下，降低实体融资成本仍是政策目标，货币政策预计延续适度宽松的基调，对债券市场偏利好；2025 年积极的财政政策发力，政府债供给放量，预计 2025 年在利多与利空因素的交织影响下，利率保持震荡走势，关注机构止盈行为、政府债供给放量带来的调整，波段操作增厚收益。下一阶段，本产品继续灵活调整久期和杠杆，优化组合期限结构，在控制好回撤的基础上争取更好的收益回报。

#### 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，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金资产估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司管理层下设立估值委员会，常任委员由公司总经理、分管投资部门、研究部、运营部高管及稽核风控部、投资部门（含权益投资部、专户业

务部、固定收益投资部)、研究部、基金运营部等部门负责人担任。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内,参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 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《太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的约定:在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可对本基金进行基金分红。本基金管理人在本报告期内实施一次分红,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,本基金托管人在对本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,本基金的管理人——太平基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对太平基金管理有限公司编制和披露的太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年年度报告中财务指标、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进行了复核,以上内容真实、准确和完整。

§ 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     | 毕马威华振审字第 2506469 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 | 太平恒泰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>我们审计了后附的太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 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”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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(以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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>                                                                                                                                                       |
| 强调事项            | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 其他事项            | -                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 其他信息            | <p>该基金管理人太平基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>                               |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,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该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,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>基金管理人治理层负责监督该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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                             |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |    |
|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|           | <p>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>(1) 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>(2) 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>(3) 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>(4) 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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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 | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |
| 注册会计师的姓名  | 张楠                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 许雯 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |    |
| 审计报告日期    | 2025 年 03 月 27 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |    |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产  | 附注号 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------|-----|-------------------------|--------------------------|
| 资 产： |     |                         |                          |

|               |            |                                 |                                  |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 货币资金          | 7.4.7.1    | 6,784,365.31                    | 5,702,808.85                     |
| 结算备付金         |            | -                               | -                                |
| 存出保证金         |            | -                               | 5,976.01                         |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 3,773,437,708.50                | 1,183,065,267.87                 |
| 其中：股票投资       |            | -                               | -                                |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 3,773,437,708.50                | 1,183,065,267.87                 |
| 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    | 289,022,527.52                  | -                                |
| 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         |            | -                               | -                                |
| 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          |            | 4,069,244,601.33                | 1,188,774,052.73                 |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 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     |            | -                               | 290,575,919.20                   |
| 应付清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 315,644.31                      | 297,078.95                       |
| 应付托管费         |            | 105,214.77                      | 99,026.31                        |
| 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    | 208,078.84                      | 188,040.71                       |
| 负债合计          |            | 628,937.92                      | 291,160,065.17                   |
| <b>净资产：</b>   |            |                                 |                                  |

|          |          |                  |                  |
|----------|----------|------------------|------------------|
| 实收基金     | 7.4.7.10 | 3,897,680,323.71 | 885,015,570.92   |
| 未分配利润    | 7.4.7.11 | 170,935,339.70   | 12,598,416.64    |
| 净资产合计    |          | 4,068,615,663.41 | 897,613,987.56   |
| 负债和净资产总计 |          | 4,069,244,601.33 | 1,188,774,052.73 |

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，太平恒泰三个月定开债 A 份额净值 1.0439 元，基金份额总额 3,897,680,323.71 份，太平恒泰三个月定开债 C 份额净值 1.0439 元，基金份额总额 0.00 份，总份额合计 3,897,680,323.71 份。

7.2 利润表

会计主体：太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 7 日（基金合<br>同生效日）至 2023 年 12<br>月 31 日 |
|----------------------------|----------|-------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 一、营业总收入                    |          | 55,178,981.34                             | 21,997,350.65                                               |
| 1. 利息收入                    |          | 133,562.89                                | 1,340,642.08                                                |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.12 | 14,031.59                                 | 52,322.40                                                   |
| 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             |          | 119,531.30                                | 1,288,319.68                                                |
| 其他利息收入                     |          | -                                         | -                                                           |
| 2. 投资收益（损失以“-”<br>填列）      |          | 44,350,452.80                             | 18,974,456.07                                               |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.13 | -                                         | -                                                           |
| 基金投资收益                     |          | -                                         | -                                                           |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.14 | 44,350,452.80                             | 18,974,456.07                                               |
| 资产支持证券投<br>资收益             | 7.4.7.15 | -                                         | -                                                           |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.16 | -                                         | -                                                           |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.17 | -                                         | -                                                           |
| 股利收益                       | 7.4.7.18 | -                                         | -                                                           |
| 其他投资收益                     |          | -                                         | -                                                           |
| 3. 公允价值变动收益（损<br>失以“-”号填列） | 7.4.7.19 | 10,694,965.65                             | 1,682,252.50                                                |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）     |          | -                                         | -                                                           |
| 5. 其他收入（损失以“-”<br>号填列）     | 7.4.7.20 | -                                         | -                                                           |

|                     |            |               |               |
|---------------------|------------|---------------|---------------|
| 减：二、营业总支出           |            | 5,651,455.16  | 4,827,572.26  |
| 1. 管理人报酬            | 7.4.10.2.1 | 2,597,233.92  | 2,066,079.84  |
| 其中：暂估管理人报酬          |            | -             | -             |
| 2. 托管费              | 7.4.10.2.2 | 865,744.68    | 688,693.23    |
| 3. 销售服务费            | 7.4.10.2.3 | 4,922.35      | -             |
| 4. 投资顾问费            |            | -             | -             |
| 5. 利息支出             |            | 1,991,354.21  | 1,898,099.19  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 1,991,354.21  | 1,898,099.19  |
| 6. 信用减值损失           | 7.4.7.21   | -             | -             |
| 7. 税金及附加            |            | -             | -             |
| 8. 其他费用             | 7.4.7.22   | 192,200.00    | 174,700.00    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 49,527,526.18 | 17,169,778.39 |
| 减：所得税费用             |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 49,527,526.18 | 17,169,778.39 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -             | -             |
| 六、综合收益总额            |            | 49,527,526.18 | 17,169,778.39 |

7.3 净资产变动表

会计主体：太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期                               |                |                  |
|-------------------------------------|----------------------------------|----------------|------------------|
|                                     | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                |                  |
|                                     | 实收基金                             | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                           | 885,015,570.92                   | 12,598,416.64  | 897,613,987.56   |
| 二、本期期初净资产                           | 885,015,570.92                   | 12,598,416.64  | 897,613,987.56   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | 3,012,664,752.79                 | 158,336,923.06 | 3,171,001,675.85 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                | 49,527,526.18  | 49,527,526.18    |
| （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） | 3,012,664,752.79                 | 124,689,425.55 | 3,137,354,178.34 |
| 其中：1. 基金申购款                         | 3,808,617,539.56                 | 136,383,532.28 | 3,945,001,071.84 |
| 2. 基金赎回                             | -795,952,786.77                  | -11,694,106.73 | -807,646,893.50  |

|                                          |                                                      |                |                  |
|------------------------------------------|------------------------------------------------------|----------------|------------------|
| 款                                        |                                                      |                |                  |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                                    | -15,880,028.67 | -15,880,028.67   |
| 四、本期期末净资产                                | 3,897,680,323.71                                     | 170,935,339.70 | 4,068,615,663.41 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |                |                  |
|                                          | 实收基金                                                 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | -                                                    | -              | -                |
| 二、本期期初净资产                                | 1,285,015,642.93                                     | -              | 1,285,015,642.93 |
| 三、本期增减变动额<br>（减少以“-”号填列）                 | -400,000,072.01                                      | 12,598,416.64  | -387,401,655.37  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                                    | 17,169,778.39  | 17,169,778.39    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>（净资产减少以“-”号填列）  | -400,000,072.01                                      | -4,571,361.75  | -404,571,433.76  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 198,854,621.37                                       | 1,143,409.63   | 199,998,031.00   |
| 2. 基金赎回款                                 | -598,854,693.38                                      | -5,714,771.38  | -604,569,464.76  |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                                    | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 885,015,570.92                                       | 12,598,416.64  | 897,613,987.56   |

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  
基金管理人负责人

邓先虎  
主管会计工作负责人

王瑞瑾  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

太平恒泰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[2023]第 392 号《关于准予太平恒泰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《太平恒泰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。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,285,015,642.57 元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。经向中国证监会备案,《太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 6 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,285,015,642.93 份基金份额,其中认购资金利息折合 0.36 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,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》以及更新的《太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定,自 2024 年 1 月 17 日,本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时,收取申购费用,并不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;不收取申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,包含 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额、C 类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平恒泰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金融工具,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、央行票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,但在每个开放期开始前 10 个工作日和开放期结束后 10 个工作日以及开放期内不受前述投资组合比例的限制。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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内,本基金不受前述 5%的限制。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价指数收益率。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 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。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(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。

(3) 衍生金融工具

本基金将衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 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份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包

含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计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、托管费和销售服务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

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按红利派发日的基金份额净值折算成基金份额，红利再投资的份额免收申购费；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。除法律法规另有规定或《太平恒泰三个月定期开

放债券型证券投资基金基金合同》另有约定外，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后，可对上述基金收益分配政策进行调整，不需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 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

本基金于本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金于本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

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>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 6,784,365.31            | 5,702,808.85             |
| 等于：本金          | 6,778,305.78            | 5,700,834.22             |
| 加：应计利息         | 6,059.53                | 1,974.63                 |
| 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             | 6,784,365.31            | 5,702,808.85             |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2024 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 | -                       | -             | -                | -             |
|               | 银行间市  | 3,719,763,781.85        | 41,296,708.50 | 3,773,437,708.50 | 12,377,218.15 |

|               | 场                        |                  |               |                  |               |
|---------------|--------------------------|------------------|---------------|------------------|---------------|
|               | 合计                       | 3,719,763,781.85 | 41,296,708.50 | 3,773,437,708.50 | 12,377,218.15 |
| 资产支持证券        |                          | -                | -             | -                | -             |
| 基金            |                          | -                | -             | -                | -             |
| 其他            |                          | -                | -             | -                | -             |
| 合计            |                          | 3,719,763,781.85 | 41,296,708.50 | 3,773,437,708.50 | 12,377,218.15 |
| 项目            | 上年度末<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                    | -                | -             | -                | -             |
|               | 银行间市场                    | 1,167,760,747.50 | 13,622,267.87 | 1,183,065,267.87 | 1,682,252.50  |
|               | 合计                       | 1,167,760,747.50 | 13,622,267.87 | 1,183,065,267.87 | 1,682,252.50  |
| 资产支持证券        |                          | -                | -             | -                | -             |
| 基金            |                          | -                | -             | -                | -             |
| 其他            |                          | -                | -             | -                | -             |
| 合计            |                          | 1,167,760,747.50 | 13,622,267.87 | 1,183,065,267.87 | 1,682,252.50  |

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>2024 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 | 289,022,527.52           | -         |
| 合计    | 289,022,527.52           | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |           |

|       | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
|-------|------|-----------|
| 交易所市场 | -    | -         |
| 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任何其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 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      | 53,078.84               | 23,040.71                |

|          |            |            |
|----------|------------|------------|
| 其中：交易所市场 | -          | -          |
| 银行间市场    | 53,078.84  | 23,040.71  |
| 应付利息     | -          | -          |
| 预提信息披露费  | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 预提审计费    | 35,000.00  | 45,000.00  |
| 合计       | 208,078.84 | 188,040.71 |

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

太平恒泰三个月定开债 A

| 项目            | 本期                               |                  |
|---------------|----------------------------------|------------------|
|               | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                  |
|               | 基金份额（份）                          | 账面金额             |
| 上年度末          | 885,015,570.92                   | 885,015,570.92   |
| 本期申购          | 3,512,667,065.00                 | 3,512,667,065.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -500,002,312.21                  | -500,002,312.21  |
| 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           | 3,897,680,323.71                 | 3,897,680,323.71 |

太平恒泰三个月定开债 C

| 项目            | 本期                                |                 |
|---------------|-----------------------------------|-----------------|
|               | 2024 年 1 月 17 日至 2024 年 12 月 31 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                           | 账面金额            |
| 上年度末          | -                                 | -               |
| 本期申购          | 295,950,474.56                    | 295,950,474.56  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -295,950,474.56                   | -295,950,474.56 |
| 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           | -                                 | -               |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

太平恒泰三个月定开债 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 11,290,995.99  | 1,307,420.65  | 12,598,416.64  |
| 本期期初           | 11,290,995.99  | 1,307,420.65  | 12,598,416.64  |
| 本期利润           | 38,707,007.61  | 10,531,045.42 | 49,238,053.03  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 123,206,410.98 | 1,772,487.72  | 124,978,898.70 |

|          |                |               |                |
|----------|----------------|---------------|----------------|
| 其中：基金申购款 | 130,448,010.06 | 1,880,996.78  | 132,329,006.84 |
| 基金赎回款    | -7,241,599.08  | -108,509.06   | -7,350,108.14  |
| 本期已分配利润  | -15,880,028.67 | -             | -15,880,028.67 |
| 本期末      | 157,324,385.91 | 13,610,953.79 | 170,935,339.70 |

太平恒泰三个月定开债 C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -             | -           | -             |
| 本期期初           | -             | -           | -             |
| 本期利润           | 125,552.92    | 163,920.23  | 289,473.15    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -125,552.92   | -163,920.23 | -289,473.15   |
| 其中：基金申购款       | 4,154,201.71  | -99,676.27  | 4,054,525.44  |
| 基金赎回款          | -4,279,754.63 | -64,243.96  | -4,343,998.59 |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | -             | -           | -             |

7.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 13,949.15                              | 27,441.46                                            |
| 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 | -                                      | 24,864.74                                            |
| 其他        | 82.44                                  | 16.20                                                |
| 合计        | 14,031.59                              | 52,322.40                                            |

7.4.7.13 股票投资收益

7.4.7.13.1 股票投资收益项目构成

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-买卖股票差价收入。

7.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31 | 上年度可比期间<br>2023年6月7日（基金合同生效 |
|----|----------------------------|-----------------------------|
|----|----------------------------|-----------------------------|

|                              | 日             | 日) 至2023年12月31日 |
|------------------------------|---------------|-----------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 27,451,332.01 | 19,209,543.58   |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 16,899,120.79 | -235,087.51     |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -             | -               |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -             | -               |
| 合计                           | 44,350,452.80 | 18,974,456.07   |

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年6月7日（基金合同生效日）至2023年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|-------------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 4,596,617,606.44            | 1,093,236,015.90                          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,537,069,399.33            | 1,079,823,817.50                          |
| 减：应计利息总额               | 42,572,911.32               | 13,628,635.91                             |
| 减：交易费用                 | 76,175.00                   | 18,650.00                                 |
| 买卖债券差价收入               | 16,899,120.79               | -235,087.51                               |

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金于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。

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

7.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金于本报告期内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。

7.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内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。

7.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内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。

7.4.7.16 贵金属投资收益

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17 衍生工具收益

7.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金于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。

7.4.7.18 股利收益

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 7 日（基金合<br>同生效日）至 2023 年 12 月 31<br>日 |
|----------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 10,694,965.65                             | 1,682,252.50                                                |
| 股票投资                       | -                                         | -                                                           |
| 债券投资                       | 10,694,965.65                             | 1,682,252.50                                                |
| 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                         | 10,694,965.65                             | 1,682,252.50                                                |

7.4.7.20 其他收入

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.21 信用减值损失

本基金于本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 7 日（基金合同生效日）<br>至 2023 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| 审计费用    | 35,000.00                              | 45,000.00                                                |
| 信息披露费   | 120,000.00                             | 120,000.00                                               |
| 证券出借违约金 | -                                      | -                                                        |
| 账户维护费   | 37,200.00                              | 9,300.00                                                 |
| 开户费     | -                                      | 400.00                                                   |
| 合计      | 192,200.00                             | 174,700.00                                               |

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

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 |
| 浙商银行股份有限公司（“浙商银行”） | 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：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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

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

7.4.10.1.2 债券交易

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

7.4.10.1.3 债券回购交易

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

7.4.10.1.4 权证交易

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

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

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>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |
|------------------|----------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 2,597,233.92                           | 2,066,079.84                                         |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 723,110.34                             | 312,464.63                                           |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,874,123.58                           | 1,753,615.21                                         |

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

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 865,744.68                             | 688,693.23                                           |

注：支付基金托管人浙商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：

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日               |                  |          |
|----------------|------------------------------------------------------|------------------|----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                     |                  |          |
|                | 太平恒泰三个月定开<br>债 A                                     | 太平恒泰三个月定开<br>债 C | 合计       |
|                | 太平基金                                                 | -                | 4,921.42 |
| 合计             | -                                                    | 4,921.42         | 4,921.42 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |                  |          |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                     |                  |          |
|                |                                                      |                  |          |

|    | 太平恒泰三个月定开<br>债 A | 太平恒泰三个月定开<br>债 C | 合计 |
|----|------------------|------------------|----|
| -  | -                | -                | -  |
| 合计 | -                | -                | -  |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 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：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类的基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

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

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

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

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

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

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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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

太平恒泰三个月定开债 A

| 关联方名称 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 |                              | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |                              |
|-------|-------------------------|------------------------------|--------------------------|------------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>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 (%) |
| 太平人寿  | 1,921,782,454.12        | 49.3058                      | 499,999,000.00           | 56.4961                      |
| 浙商银行  | 1,947,054,980.79        | 49.9542                      | 384,999,000.00           | 43.5019                      |

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

除基金管理人之外的其他关联方按照本基金基金合同、招募说明书的约定费率进行认购、申

购和赎回，不享有比其他投资人更优惠的费率。

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                               |           | 上年度可比期间                         |           |
|-------|----------------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|       | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |           | 2023年6月7日（基金合同生效日）至2023 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    |
| 浙商银行  | 6,784,365.31                     | 13,949.15 | 5,702,808.85                    | 27,441.46 |

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于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

| 太平恒泰三个月定开债 A |                    |     |                    |                       |                      |                   |                   |    |
|--------------|--------------------|-----|--------------------|-----------------------|----------------------|-------------------|-------------------|----|
| 序号           | 权益<br>登记日          | 除息日 |                    | 每 10 份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形<br>式<br>发放总<br>额 | 再投资形<br>式<br>发放总额 | 本期利<br>润分配<br>合计  | 备注 |
|              |                    | 场内  | 场外                 |                       |                      |                   |                   |    |
| 1            | 2024 年 9<br>月 26 日 | -   | 2024 年 9<br>月 26 日 | 0.2000                | 15,879,95<br>6.83    | 71.84             | 15,880,02<br>8.67 | -  |
| 合计           | -                  | -   | -                  | 0.2000                | 15,879,95<br>6.83    | 71.84             | 15,880,02<br>8.67 | -  |

7.4.12 期末（2024 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

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受约束的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2024 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

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 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，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于证券投资基金中较低预期风险/收益的产品。本基金投资的金融工具主要包括具有良好流动性的固定收益类品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

##### 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，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>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | -                       | 60,186,295.08            |
| 合计     | -                       | 60,186,295.08            |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、短期未评级债券为政策性金融债。

7.4.13.2.2 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>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 2,057,445,343.55        | -                        |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 1,715,992,364.95        | 1,122,878,972.79         |
| 合计     | 3,773,437,708.50        | 1,122,878,972.79         |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、长期未评级债券为政策性金融债。

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 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。

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

#### 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>2024 年 12 月 31 日  | 1 年以内           | 1-5 年            | 5 年以上             | 不计息         | 合计               |
|--------------------------|-----------------|------------------|-------------------|-------------|------------------|
| 资产                       |                 |                  |                   |             |                  |
| 货币资金                     | 6,784,365.31    | -                | -                 | -           | 6,784,365.31     |
| 交易性金融资产                  | 253,727,054.79  | 1,106,090,475.11 | 12,413,620,178.60 | -           | 3,773,437,708.50 |
| 买入返售金融资产                 | 289,022,527.52  | -                | -                 | -           | 289,022,527.52   |
| 资产总计                     | 549,533,947.62  | 1,106,090,475.11 | 12,413,620,178.60 | -           | 4,069,244,601.33 |
| 负债                       |                 |                  |                   |             |                  |
| 应付管理人报酬                  | -               | -                | -                 | 315,644.31  | 315,644.31       |
| 应付托管费                    | -               | -                | -                 | 105,214.77  | 105,214.77       |
| 其他负债                     | -               | -                | -                 | 208,078.84  | 208,078.84       |
| 负债总计                     | -               | -                | -                 | 628,937.92  | 628,937.92       |
| 利率敏感度缺口                  | 549,533,947.62  | 1,106,090,475.11 | 12,413,620,178.60 | -628,937.92 | 4,068,615,663.41 |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内           | 1-5 年            | 5 年以上             | 不计息         | 合计               |
| 资产                       |                 |                  |                   |             |                  |
| 货币资金                     | 5,702,808.85    | -                | -                 | -           | 5,702,808.85     |
| 存出保证金                    | 5,976.01        | -                | -                 | -           | 5,976.01         |
| 交易性金融资产                  | 60,186,295.08   | 1,122,878,972.79 | -                 | -           | 1,183,065,267.87 |
| 资产总计                     | 65,895,079.94   | 1,122,878,972.79 | -                 | -           | 1,188,774,052.73 |
| 负债                       |                 |                  |                   |             |                  |
| 应付管理人报酬                  | -               | -                | -                 | 297,078.95  | 297,078.95       |
| 应付托管费                    | -               | -                | -                 | 99,026.31   | 99,026.31        |
| 卖出回购金融资产款                | 290,575,919.20  | -                | -                 | -           | 290,575,919.20   |
| 其他负债                     | -               | -                | -                 | 188,040.71  | 188,040.71       |
| 负债总计                     | 290,575,919.20  | -                | -                 | 584,145.97  | 291,160,065.17   |
| 利率敏感度缺口                  | -224,680,839.26 | 1,122,878,972.79 | -                 | -584,145.97 | 897,613,987.56   |

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（2024 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点                                     | 54,936,101.16               | 5,442,273.50           |
|    | 市场利率上升 25 个基点                                     | -53,820,729.03              | -5,402,192.53          |

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：<br><br>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>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 3,773,437,708.50        | 1,183,065,267.87         |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 3,773,437,708.50        | 1,183,065,267.87         |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

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

本基金于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

本基金于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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日：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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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            | 3,773,437,708.50 | 92.73         |
|    | 其中：债券             | 3,773,437,708.50 | 92.73         |
|    | 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          | 289,022,527.52   | 7.10          |
|    | 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      | 6,784,365.31     | 0.17          |
| 8  | 其他各项资产            | -                | -             |
| 9  | 合计                | 4,069,244,601.33 | 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

本基金本报告期内未持有股票。

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

本基金本报告期内未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

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      | -                | -             |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 3,773,437,708.50 | 92.75         |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,715,992,364.95 | 42.18         |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 4  | 企业债券      | -                | -     |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -     |
| 6  | 中期票据      | -                | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -     |
| 8  | 同业存单      | -                | -     |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 3,773,437,708.50 | 92.75 |

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  | 230203 | 23 国开 03 | 2,500,000 | 266,438,524.59 | 6.55         |
| 2  | 240203 | 24 国开 03 | 2,500,000 | 263,308,060.11 | 6.47         |
| 3  | 230208 | 23 国开 08 | 2,500,000 | 262,864,520.55 | 6.46         |
| 4  | 230415 | 23 农发 15 | 2,500,000 | 261,811,301.37 | 6.43         |
| 5  | 220412 | 22 农发 12 | 2,500,000 | 253,727,054.79 | 6.24         |

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投资国债期货。

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

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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

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

| 份额级别                 | 持有人<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额      | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 太平恒泰<br>三个月定<br>开债 A | 267              | 14,598,053.65 | 3,897,665,995.36 | 99.9996           | 14,328.35 | 0.0004            |
| 太平恒泰<br>三个月定<br>开债 C | 0                | —             | —                | —                 | —         | —                 |
| 合计                   | 267              | 14,598,053.65 | 3,897,665,995.36 | 99.9996           | 14,328.35 | 0.0004            |

注：在同一基金账号同时持有 A 类份额和 C 类份额的情况下，按一户统计持有人户数。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                           | 份额级别         | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------------------|--------------|-----------|-------------|
| 基金管<br>理人所有从业<br>人员持有本基<br>金 | 太平恒泰三个月定开债 A | 10,396.76 | 0.0003      |
|                              | 太平恒泰三个月定开债 C | —         | —           |
|                              | 合计           | 10,396.76 | 0.0003      |

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 | 份额级别 | 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 | 太平恒泰三个月定开债 A | 0~10 |
|                                | 太平恒泰三个月定开债 C | 0    |
|                                | 合计           | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 太平恒泰三个月定开债 A | 0~10 |
|                                | 太平恒泰三个月定开债 C | 0    |
|                                | 合计           | 0~10 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                    | 太平恒泰三个月定开债 A     | 太平恒泰三个月定开债 C   |
|---------------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>(2023 年 6 月 7 日)<br>基金份额总额 | 1,285,015,642.93 | —              |
| 本报告期期初基金份额总额                          | 885,015,570.92   | —              |
| 本报告期基金总申购份额                           | 3,512,667,065.00 | 295,950,474.56 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                         | 500,002,312.21   | 295,950,474.56 |
| 本报告期基金拆分变动份额                          | —                | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                          | 3,897,680,323.71 | —              |

§ 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 2024 年 12 月 6 日发布公告，自 2024 年 12 月 4 日起，刘冬先生担任公司董事长职务，焦艳军先生不再担任公司董事长职务；

(2) 本基金管理人于 2024 年 12 月 16 日发布公告，自 2024 年 12 月 13 日起，公司法定代表人变更为刘冬先生。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，聘任毕马威华振会计师事务所（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叁万伍仟元整。

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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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(%) |    |
| 申万宏源证券 | 2      | -    | -               | -         | -             | -  |

注：1. 拟被基金管理人租用交易单元的证券公司应符合以下标准：

（1）公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定。最近一年未出现亏损或审计机构无法出具无保留意见的审计报告等情形。

（2）经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到监管部门处罚。

（3）合规风控能力较强。内部管理规范、严格，具备健全的内控和风控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（4）交易服务能力较强。具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要。

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

(6) 与公司签订综合服务协议。

2. 交易单元的选择程序：

(1) 基金管理人的总经理办公会根据上述标准确定可以合作的证券公司名单，由投资决策委员会在上述名单内确定租用的交易单元。

(2) 基金管理人与被选择的证券公司签订协议，租用交易单元开展证券交易。

3. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

本基金于本报告期内无新增交易单元。

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(%) |
| 申万宏源证券 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |

注：本基金于本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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  | 关于太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金 开放期调整的公告                      | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 16 日 |
| 2  | 关于太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金增加 C 类基金份额以及相应修改法律文件的公告        | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 17 日 |
| 3  | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议（更新）                         | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 17 日 |
| 4  | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同（更新）                         | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 17 日 |
| 5  | 太平基金管理有限公司太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号） | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 17 日 |
| 6  | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新                | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 17 日 |
| 7  | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新                | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 17 日 |
| 8  | 太平基金管理有限公司关于旗下基金                                     | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 18 日 |

|    |                                                |           |                  |
|----|------------------------------------------------|-----------|------------------|
|    | 增加招商银行股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告                   |           |                  |
| 9  | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第四季度报告              | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 22 日 |
| 10 | 太平基金管理有限公司关于太平恒泰三个月定期开放债券型基金提高 C 类份额净值精度的公告    | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 01 月 26 日 |
| 11 | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 03 月 13 日 |
| 12 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年年度报告                | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 03 月 30 日 |
| 13 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 2 号）     | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 04 月 20 日 |
| 14 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新          | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 04 月 20 日 |
| 15 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新          | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 04 月 20 日 |
| 16 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年第一季度报告              | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 04 月 22 日 |
| 17 | 太平恒泰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 | 2024 年 04 月 24 日 |
| 18 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新          | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 06 月 28 日 |
| 19 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新          | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 06 月 28 日 |
| 20 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年第二季度报告              | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 07 月 19 日 |
| 21 | 太平恒泰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 | 2024 年 08 月 08 日 |
| 22 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年中期报告                | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 08 月 30 日 |
| 23 | 太平恒泰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 | 2024 年 09 月 25 日 |
| 24 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年第三季度报告              | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 10 月 25 日 |
| 25 | 太平恒泰三个月定期开放债券型证券                               | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 12 月 05 日 |

|    |                        |           |                  |
|----|------------------------|-----------|------------------|
|    | 投资基金开放日常申购、赎回、转换等业务公告  |           |                  |
| 26 | 太平基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024 年 12 月 28 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              | 20240101 – 20240124、20241227 – 20241231 | 499,999,000.00 | 1,921,782,454.12 | 499,999,000.00 | 1,921,782,454.12 | 49.3058 |
| 机构                                                                                                                                         | 2              | 20240101 – 20241231                     | 384,999,000.00 | 1,562,055,980.79 | –              | 1,947,054,980.79 | 49.9542 |
| 机构                                                                                                                                         | 3              | 20240118 – 20240124                     | –              | 295,945,546.02   | 295,945,546.02 | –                | 0.0000  |
| 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、《太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平恒泰三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平恒泰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

2025 年 3 月 31 日