

太平丰和一年定期开放债券型发起式证券  
投资基金  
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 太平丰和一年定开债券发起式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 010165                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金运作方式     | 契约型、定期开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金合同生效日    | 2020 年 9 月 17 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 报告期末基金份额总额 | 7,009,998,000.00 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 投资目标       | 本基金在追求资产长期稳健增值的基础上，力争为份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 投资策略       | <p>本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产、权益类资产、现金类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，以规避市场风险，提高基金收益率。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、资产支持证券投资策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。</p> <p>1、久期策略</p> <p>本基金将基于对宏观经济政策的分析，积极的预测未来利率变化趋势，并根据预测确定相应的久期目标，调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时，本基金将适当降低组合久期；而预期市场利率将</p> |

下降时，则适当提高组合久期。在确定债券组合久期的过程中，本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。

2、收益率曲线策略在组合的久期配置确定以后，本基金将通过对收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

3、类属配置策略本基金对不同类别债券的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

4、利率品种策略本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

#### 5、信用债策略：

本基金所指信用债包括：金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债和中期票据等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用担保的固定收益类金融工具。

本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产的 20%，并且不得投资于信用评级低于 AA+ 的信用债，其中投资于 AA+ 评级信用债的比例不超过信用债资产总值的 50%，投资于 AAA 评级信用债的比例占信用债资产总值的 50%-100%。

金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、资产支持证券、次级债和中期票据等信用债的信用评级依照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级；短期融资券和超短期融资券等信用债的信用评级依照基金管理人选定评级机构出具的主体信用评级。本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值 and 风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### 7、国债期货投资策略

基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，谨慎进行对国债期货的投资。</p> <p>8、杠杆投资策略</p> <p>本基金可在封闭期内进行杠杆投资，所获得资金仍主要投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益品种，并采取买入并持有到期的策略。本基金采用滚动回购的方式维持杠杆，因此负债的资金成本存在一定的波动性。</p> <p>9、可转换债券投资策略</p> <p>着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究，同时兼顾其债券价值和转换期权价值，对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。本基金管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等，并参考同类公司的估值水平，研判发行公司的投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。</p> <p>10、股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资策略以精选个股为主，发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，从定量和定性两个方面考察上市公司的增值潜力。定量方面综合考虑盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，包括净资产与市值比率（B/P）、每股盈利/每股市价（E/P）、年现金流/市值（cashflow-to-price）和销售收入/市值（S/P）等价值指标以及净资产收益率（ROE）、每股收益增长率和主营业务收入增长率等成长指标。定性方面考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势等多种因素，精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>在开放期，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化，基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金管理人  | 太平基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 基金托管人  | 中国邮政储蓄银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标     | 报告期（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日） |
|------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -66,078,200.44                      |
| 2. 本期利润    | -172,890,401.35                     |

|                 |                  |
|-----------------|------------------|
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0247          |
| 4. 期末基金资产净值     | 6,951,169,489.99 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9916           |

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

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

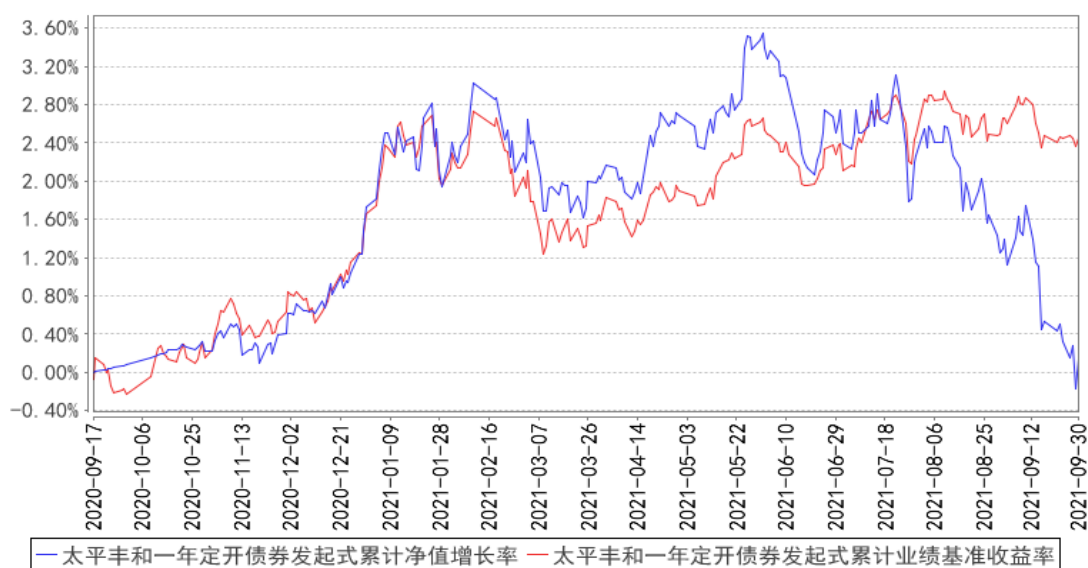
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | -2.42%     | 0.24%         | 0.08%          | 0.13%                 | -2.50% | 0.11% |
| 过去六个月          | -1.84%     | 0.20%         | 0.85%          | 0.12%                 | -2.69% | 0.08% |
| 过去一年           | 0.06%      | 0.19%         | 2.69%          | 0.14%                 | -2.63% | 0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.14%      | 0.18%         | 2.45%          | 0.14%                 | -2.31% | 0.04% |

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

太平丰和一年定开债券发起式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 2020 年 9 月 17 日，本基金的建仓期为六个月，截至报告期末本基金已完成建仓，各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务                                                                                                  | 任本基金的基金经理期限      |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                                     | 任职日期             | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 陈晓 | 固定收益投资部总监、本基金的基金经理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理、太平睿安混合型证券投资基金基金经理、太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、太平睿享混合型证券投资基金基金经理 | 2020 年 09 月 17 日 | -    | 11 年   | 南开大学精算学专业经济学硕士。2010 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任投资部研究助理、固定收益研究员、固定收益高级研究员。2014 年 1 月先后担任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安和债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安诚债券型证券投资基金基金经理、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 11 月加入太平基金管理有限公司，现任固定收益投资部总监。2019 年 3 月 29 日至 2020 年 4 月 15 日担任太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理。2019 年 3 月 29 日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 17 日起担任太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 10 日起担任太平睿安混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 22 日起担任太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 17 日起担任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，

不存在损害基金份额持有人利益的行为，不存在违法违规或未履行基金合同的情形。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及有关法规，建立公司内部的公平交易管理制度体系，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，以确保公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，防范不公平交易和利益输送行为。

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年第三季度国内经济复苏态势略有减弱，一方面去年三季度经济恢复较快基数较高，另外一方面国内疫情零星反复以及极端天气带来部分扰动，同时双限政策的落实对部分高耗能行业限制较为明显。

权益市场三季度指数相对平稳，但内部结构继续分化：7-8 月电力设备及新能源、光伏、电力、公用事业等板块涨幅明显，9 月后市场风格略有转变，前期跌幅较多的消费、医药、金融等传统板块开始反弹，同时市场开始交易通胀预期。本季度组合行业配置调整的较为均衡，净值波动相对较小。

债券市场三季度整体呈现先涨后跌的行情，7 月初央行全面降准大超预期，债券 7 月涨幅较多，8-9 月债市整体处于震荡区间，机会较少。经济数据虽然偏弱但通胀数据高企，整体环境呈现类滞胀局面。三季度地方债发行逐渐提速，预计四季度短期仍有一定的供给压力。可转债市场整体表现较好，低价和平衡性转债整体溢价率继续抬升。

本报告期内，债券部分根据市场变化，对久期和杠杆进行微调，使之保持在适度水平，同时继续重点布局高等级信用债和金融债，并阶段性参与利率债市场和可转债市场的交易机会，力争获得资本利得增厚。权益部分仍保持稳中求进、精选个股的风格，利用动态的仓位调整来控制回撤风险，力争为投资人取得长期回报。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-2.42%，同期业绩比较基准为 0.08%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警的情况。

# § 5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 1,316,041,325.91 | 17.19        |
|    | 其中：股票             | 1,316,041,325.91 | 17.19        |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 6,168,932,905.18 | 80.56        |
|    | 其中：债券             | 5,358,006,005.18 | 69.97        |
|    | 资产支持证券            | 810,926,900.00   | 10.59        |
| 4  | 贵金属投资             | —                | —            |
| 5  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 6  | 买入返售金融资产          | —                | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —                | —            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 44,309,290.91    | 0.58         |
| 8  | 其他资产              | 127,979,085.58   | 1.67         |
| 9  | 合计                | 7,657,262,607.58 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —                | —            |
| B  | 采矿业              | 28,252,000.00    | 0.41         |
| C  | 制造业              | 1,054,002,523.60 | 15.16        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 29,772,000.00    | 0.43         |
| E  | 建筑业              | —                | —            |
| F  | 批发和零售业           | —                | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —                | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —                | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —                | —            |
| J  | 金融业              | 162,780,652.71   | 2.34         |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| K | 房地产业          | —                | —     |
| L | 租赁和商务服务业      | —                | —     |
| M | 科学研究和技术服务业    | 41,234,149.60    | 0.59  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | —                | —     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | —                | —     |
| P | 教育            | —                | —     |
| Q | 卫生和社会工作       | —                | —     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | —                | —     |
| S | 综合            | —                | —     |
|   | 合计            | 1,316,041,325.91 | 18.93 |

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 300298 | 三诺生物 | 5,494,202 | 129,278,573.06 | 1.86         |
| 2  | 002049 | 紫光国微 | 400,000   | 82,720,000.00  | 1.19         |
| 3  | 002371 | 北方华创 | 214,000   | 78,257,660.00  | 1.13         |
| 4  | 002812 | 恩捷股份 | 234,000   | 65,548,080.00  | 0.94         |
| 5  | 603986 | 兆易创新 | 450,036   | 65,250,719.64  | 0.94         |
| 6  | 603185 | 上机数控 | 219,913   | 61,465,683.50  | 0.88         |
| 7  | 603501 | 韦尔股份 | 249,931   | 60,635,759.91  | 0.87         |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 1,201,162 | 58,088,194.32  | 0.84         |
| 9  | 600690 | 海尔智家 | 1,900,000 | 49,685,000.00  | 0.71         |
| 10 | 601012 | 隆基股份 | 571,094   | 47,103,833.12  | 0.68         |

### 5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券 | 209,069,000.00   | 3.01         |
| 2  | 央行票据 | —                | —            |
| 3  | 金融债券 | 3,238,400,000.00 | 46.59        |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
|    | 其中：政策性金融债 | 149,860,000.00   | 2.16  |
| 4  | 企业债券      | 514,993,000.00   | 7.41  |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -     |
| 6  | 中期票据      | 1,156,448,000.00 | 16.64 |
| 7  | 可转债（可交换债） | 239,096,005.18   | 3.44  |
| 8  | 同业存单      | -                | -     |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 5,358,006,005.18 | 77.08 |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称         | 数量（张）     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 1828013   | 18 建设银行二级 02 | 2,000,000 | 207,620,000.00 | 2.99         |
| 2  | 1728018   | 17 农业银行二级    | 2,000,000 | 204,660,000.00 | 2.94         |
| 3  | 2022043   | 20 交银租赁债 01  | 2,000,000 | 203,500,000.00 | 2.93         |
| 4  | 102002134 | 20 金地 MTN004 | 2,000,000 | 203,120,000.00 | 2.92         |
| 5  | 175521    | 20 国君 G9     | 2,000,000 | 202,980,000.00 | 2.92         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码   | 证券名称      | 数量（份）     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-----------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 169585 | 20 花 04A1 | 2,000,000 | 200,020,000.00 | 2.88         |
| 2  | 137702 | 招慧 12A    | 800,000   | 80,568,000.00  | 1.16         |
| 3  | 137667 | 元熹 8 优 1  | 600,000   | 60,468,000.00  | 0.87         |
| 4  | 137663 | 辉润 02A    | 500,000   | 50,355,000.00  | 0.72         |
| 5  | 137649 | 招慧 11A    | 500,000   | 50,350,000.00  | 0.72         |
| 6  | 137789 | 汇宇 1A3    | 500,000   | 50,335,000.00  | 0.72         |
| 7  | 137647 | 21 弘基 1A  | 500,000   | 50,320,000.00  | 0.72         |
| 8  | 137840 | 汇宇 1A4    | 400,000   | 40,264,000.00  | 0.58         |
| 9  | 137636 | 睿思 04A    | 400,000   | 40,256,000.00  | 0.58         |
| 10 | 137798 | 21 申弘 1A  | 400,000   | 40,252,000.00  | 0.58         |

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体或其分支机构中，中国工商银行股份、中国农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公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内，本基金投资的前十名股票中没有出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）          |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 853,808.40     |
| 2  | 应收证券清算款 | —              |
| 3  | 应收股利    | —              |
| 4  | 应收利息    | 127,125,277.18 |
| 5  | 应收申购款   | —              |
| 6  | 其他应收款   | —              |
| 7  | 待摊费用    | —              |
| 8  | 其他      | —              |
| 9  | 合计      | 127,979,085.58 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 113026 | 核能转债 | 74,791,728.20 | 1.08         |

|   |        |          |               |      |
|---|--------|----------|---------------|------|
| 2 | 110053 | 苏银转债     | 46,721,514.00 | 0.67 |
| 3 | 127012 | 招路转债     | 39,534,356.25 | 0.57 |
| 4 | 113011 | 光大转债     | 21,635,300.00 | 0.31 |
| 5 | 132018 | G 三峡 EB1 | 12,806,619.20 | 0.18 |
| 6 | 113037 | 紫银转债     | 4,193,200.00  | 0.06 |
| 7 | 123090 | 三诺转债     | 2,165,379.60  | 0.03 |
| 8 | 128107 | 交科转债     | 789,701.00    | 0.01 |

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未有流通受限情况。

### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 7,009,998,000.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | —                |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | —                |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —                |
| 报告期期末基金份额总额               | 7,009,998,000.00 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,000,000.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额            | —             |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | —             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.1427        |

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总<br>份额比例(%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总<br>份额比例(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|---------------|---------------------|---------------|---------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,000.00 | 0.1427              | 10,000,000.00 | 0.1427              | 3 年            |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 基金经理等人员     | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 基金管理人股东     | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 其他          | -             | -                   | -             | -                   | -              |
| 合计          | 10,000,000.00 | 0.1427              | 10,000,000.00 | 0.1427              | 3 年            |

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                      | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                  |      |      | 报告期末持有基金情况       |         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|------------------|------|------|------------------|---------|
|                                                                                                                                            | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额             | 份额占比(%) |
| 机构                                                                                                                                         | 1              | 20210701-20210930       | 4,999,999,000.00 | -    | -    | 4,999,999,000.00 | 71.3267 |
| 机构                                                                                                                                         | 2              | 20210701-20210930       | 1,999,999,000.00 | -    | -    | 1,999,999,000.00 | 28.5307 |
| 产品特有风险                                                                                                                                     |                |                         |                  |      |      |                  |         |
| 本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 |                |                         |                  |      |      |                  |         |

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

1、中国证监会关于核准本基金募集的批复

- 2、《太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

## 10.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼）

## 10.3 查阅方式

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

客户服务电话：021-61560999、400-028-8699

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

太平基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日