

# 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 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       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 12        |
| 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 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>33</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 33        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 34        |
| 7.3 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       | 34        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 34        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 34        |
| 7.6 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      | 34        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 7.7 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 ..... | 35        |
| 7.8 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 ..... | 35        |
| 7.9 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 .....    | 35        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 35        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 35        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>36</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 36        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 36        |
| 8.3 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 .....      | 36        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>36</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>37</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 37        |
| 10.2 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 .....      | 37        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 37        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 37        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 37        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 37        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 37        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 38        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>39</b> |
| 11.1 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 .....    | 39        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 39        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>39</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 39        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 40        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 40        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 太平恒安三个月定开债           |
| 基金主代码      | 007545               |
| 基金运作方式     | 契约型、定期开放式            |
| 基金合同生效日    | 2019 年 6 月 27 日      |
| 基金管理人      | 太平基金管理有限公司           |
| 基金托管人      | 江苏银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额 | 1,191,546,035.34 份   |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资策略 | <p>本基金将综合运用多种债券投资策略，实现组合增值，在有效控制风险的基础上，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>在资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析，比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率，在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种，及债券与现金类资产之间进行动态调整。</p> <p>2、久期策略</p> <p>本基金将主要采取久期策略，通过自上而下的组合久期管理策略，以实现组合利率风险的有效控制。为控制风险，本基金采用以“目标久期”为中心的资产配置方式。目标久期的设定划分为两个层次：战略性配置和战术性配置。“目标久期”的战略性配置由投资决策委员会确定，主要根据对宏观经济和资本市场的预测分析决定组合的目标久期。“目标久期”的战术性配置由基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的范围内进行调整。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，直至接近目标久期上限，以较多地获得债券价格上升带来的收益；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期，直至目标久期下限，以减小债券价格下降带来的风险。</p> <p>3、收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。</p> <p>4、骑乘策略</p> <p>本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益率曲线较陡峭处右侧的债券。在收益率曲线不变动的情况下，随着其剩余期限的衰减，债券收益率将沿着陡峭的收益率曲线有较大幅度的下滑，从而获得较高的资本收益；即使收益率曲线上升或进一步变陡，这一策略也能够提供更多的安全边际。</p> <p>5、息差策略</p> <p>本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，利用杠杆放大债券投资的收益。</p> <p>6、债券选择策略</p> <p>根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                       | 基金托管人                 |
|-------------|------|-----------------------------|-----------------------|
| 名称          |      | 太平基金管理有限公司                  | 江苏银行股份有限公司            |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 赵霖                          | 周宏                    |
|             | 联系电话 | 021-38556613                | 025-58588217          |
|             | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn  | Zhouhong1@jsbchina.cn |
| 客户服务电话      |      | 021-61560999/400-028-8699   | 95319                 |
| 传真          |      | 021-38556677                | 025-58588155          |
| 注册地址        |      | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室   | 南京市中华路 26 号           |
| 办公地址        |      | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 | 南京市中华路 26 号           |
| 邮政编码        |      | 200120                      | 210001                |
| 法定代表人       |      | 范宇                          | 夏平                    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》                      |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.taipingfund.com.cn      |
| 基金中期报告备置地点          | 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                        |
|--------|------------|-----------------------------|
| 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 主要财务指标和基金净值表现

### 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 | 报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 23,163,973.74                       |
| 本期利润          | 25,735,206.59                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0226                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.13%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.17%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 69,087,552.84                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0580                              |
| 期末基金资产净值      | 1,260,633,588.18                    |
| 期末基金份额净值      | 1.0580                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 8.32%                               |

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

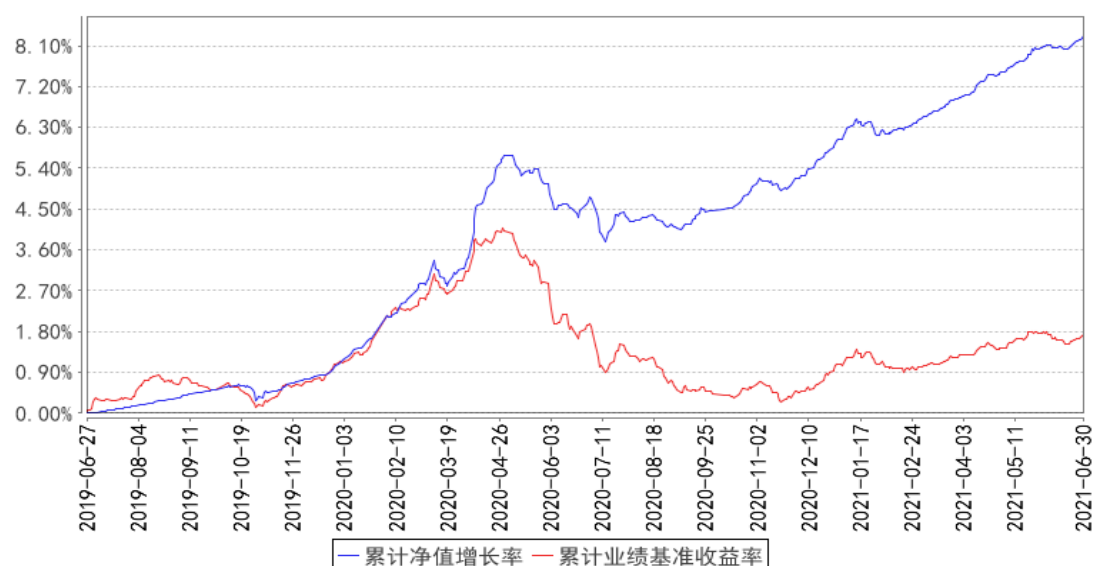
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | 0.25%    | 0.03%       | -0.04%     | 0.03%         | 0.29% | 0.00% |

|            |       |       |        |       |       |        |
|------------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去三个月      | 1.26% | 0.03% | 0.45%  | 0.03% | 0.81% | 0.00%  |
| 过去六个月      | 2.17% | 0.03% | 0.65%  | 0.04% | 1.52% | -0.01% |
| 过去一年       | 3.54% | 0.05% | -0.20% | 0.06% | 3.74% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.32% | 0.06% | 1.73%  | 0.07% | 6.59% | -0.01% |

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

太平恒安三个月定开债累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2019 年 6 月 27 日。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2019 年 6 月 27 日至 2021 年 6 月 30 日。

## § 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。目前公司注册资本为人民币 4 亿元，其中太平资产管理有限公司出

资占注册资本 91.5%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 8.5%。

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 19 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金、太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金、太平恒利纯债债券型证券投资基金、太平睿盈混合型证券投资基金、太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金、太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金、太平恒睿纯债债券型证券投资基金、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金、太平智选一年定期开放股票型发起式证券投资基金、太平行业优选股票型证券投资基金、太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平睿安混合型证券投资基金、太平恒久纯债债券型证券投资基金、太平价值增长股票型证券投资基金、太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务                                                                             | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|----|--------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 吴超 | 本基金的基金经理、太平日日金货币市场基金基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证 | 2019 年 6 月 27 日 | -    | 8 年    | 美国本特利商学院金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 5 月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公司担任部门经理、投资总监等职。2017 年 3 月加入本公司。2018 年 2 月 12 日起任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2019 年 3 月 25 日担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 27 日起任太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 28 日起任太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 7 日起担任太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 12 日起担任太平恒久纯债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 24 日起担任太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

|                                                                                                                                              |  |  |  |  |  |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|
| 券投资基金基金<br>经理、太平恒<br>泽 63 个月定期<br>开放债券型证<br>券投资基金基<br>金基金经理、<br>太平恒久纯债<br>债券型证券投<br>资基金基金经<br>理、太平丰泰<br>一年定期开放<br>债券型发起式<br>证券投资基金基<br>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，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不公平交易的情况。

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资

组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

### 4.3.2 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 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

2021 年上半年债券市场整体呈现出 V 型走势。一季度表现较弱，主要由于一季度经济基本面较好，市场预期政策收紧概率上升，同时通胀压力是制约债券市场的重要因素。二季度债券板块整体表现较好，从 3 月开始至 5 月下旬债券持续了接近一个季度的慢牛行情，最大的支撑因素来自于货币政策未如预期般收紧。5 月开始由于国内定价的黑色系大宗商品出现暴涨，对债市造成一定冲击。但很快商品价格在政策打压下出现大幅调整，债市受到的压力大大缓解。6 月后在美债利率下行、央行加码 300 亿 OMO 投放等利好之下，市场情绪明显转暖。

组合运作上恒安保持以金融债为主的套息策略，辅以利率债波段交易。在一季度恒安保持相对较低久期，在 4 月份根据央行政策态度变化果断增加部分中长久期利率债跟上市场节奏。在二季度基本保持相对中高久期运作，取得了较好的效果。在 7 月初央行全面降准后，市场预期再次升温，后续将继续结合经济基本面与市场流动性变化对交易策略进行调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 2.17%，同期业绩比较基准收益率为 0.65%

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为债市可预期的利好将逐步增多：通胀预期与通胀数据均已见顶，货币政策持续与之“脱钩”；经济下行拐点到来，虽然经济韧性较强，下行速度较为缓慢，但是监管仍然收紧，对于地产和地方债务政策不断收紧，在“宽货币、紧信用”的大环境下结构性缺资产的矛盾仍旧存在；美国紧缩预期以曲线平坦化形式实现，进程或慢于预期。因此对于债市而言，在经济潜在增速不断下行的大趋势下，收益率虽然会受到供需、流动性、外围市场等各方面的扰动，但长期来看仍将跟随经济基本面下行的概率较大。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以

及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金资产的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值和产品委员会成员由主席负责，估值分委会常任委员由稽核风控部、投资部门（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；产品分委会常任委员由稽核风控部、销售部门（含市场销售部、机构客户部）、信息技术部、基金运营部、交易部、产品经理及其所在部门负责人、拟任基金经理或投资经理及其所在部门负责人担任。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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金》的约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%。本基金管理人于 2021 年 04 月 20 日实施分红，分红方案为：每 10 份基金发放红利 0.25 元。

#### 4.8 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，在托管太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金的过程中，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人

应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，本基金托管人-江苏银行股份有限公司未发现太平基金管理有限公司在太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款        | 6.4.7.1 | 3,831,103.51           | 11,575,008.83            |
| 结算备付金       |         | 196,143.63             | 10,841.23                |
| 存出保证金       |         | 140,694.99             | 8,339.41                 |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 1,506,506,696.98       | 1,544,525,627.45         |
| 其中：股票投资     |         | -                      | -                        |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | 1,506,506,696.98       | 1,544,525,627.45         |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资       |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产    | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 应收证券清算款     |         | -                      | -                        |
| 应收利息        | 6.4.7.5 | 23,618,325.56          | 14,215,874.98            |
| 应收股利        |         | -                      | -                        |
| 应收申购款       |         | -                      | -                        |
| 递延所得税资产     |         | -                      | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.6 | -                      | -                        |

|                 |             |                                |                                  |
|-----------------|-------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产总计            |             | 1, 534, 292, 964. 67           | 1, 570, 335, 691. 90             |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b>  | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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          | 6. 4. 7. 3  | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |             | 269, 899, 392. 05              | 547, 840, 796. 40                |
| 应付证券清算款         |             | 3, 006, 916. 97                | 8, 447, 416. 28                  |
| 应付赎回款           |             | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |             | 310, 214. 79                   | 256, 254. 06                     |
| 应付托管费           |             | 103, 404. 92                   | 85, 418. 01                      |
| 应付销售服务费         |             | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6. 4. 7. 7  | 30, 056. 26                    | 48, 243. 15                      |
| 应交税费            |             | -                              | -                                |
| 应付利息            |             | 25, 253. 15                    | 82, 329. 02                      |
| 应付利润            |             | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |             | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6. 4. 7. 8  | 284, 138. 35                   | 180, 000. 00                     |
| 负债合计            |             | 273, 659, 376. 49              | 556, 940, 456. 92                |
| <b>所有者权益:</b>   |             |                                |                                  |
| 实收基金            | 6. 4. 7. 9  | 1, 191, 546, 035. 34           | 955, 835, 377. 57                |
| 未分配利润           | 6. 4. 7. 10 | 69, 087, 552. 84               | 57, 559, 857. 41                 |
| 所有者权益合计         |             | 1, 260, 633, 588. 18           | 1, 013, 395, 234. 98             |
| 负债和所有者权益总计      |             | 1, 534, 292, 964. 67           | 1, 570, 335, 691. 90             |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0580 元，基金份额总额 1,191,546,035.34 份。

## 6.2 利润表

会计主体：太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目        | 附注号         | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年<br>6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 |
|------------|-------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、收入       |             | 30, 693, 963. 68                         | 4, 891, 375. 46                               |
| 1. 利息收入    |             | 23, 952, 837. 53                         | 4, 084, 464. 10                               |
| 其中：存款利息收入  | 6. 4. 7. 11 | 52, 658. 48                              | 55, 485. 96                                   |
| 债券利息收入     |             | 23, 660, 600. 45                         | 3, 824, 160. 84                               |
| 资产支持证券利息收入 |             | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收  |             | 239, 578. 60                             | 204, 817. 30                                  |

|                        |            |               |               |
|------------------------|------------|---------------|---------------|
| 入                      |            |               |               |
| 证券出借利息收入               |            | -             | -             |
| 其他利息收入                 |            | -             | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 4,169,893.30  | 2,162,549.48  |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | -             | -             |
| 基金投资收益                 | -          | -             | -             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13.1 | 4,169,893.30  | 2,162,549.48  |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.13.2 | -             | -             |
| 收益                     |            |               |               |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.14   | -             | -             |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.15   | -             | -             |
| 股利收益                   | 6.4.7.16   | -             | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | 2,571,232.85  | -1,355,638.12 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | -             | -             |
| 减：二、费用                 |            | 4,958,757.09  | 1,022,351.81  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 1,796,356.42  | 297,276.61    |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 598,785.42    | 99,092.20     |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -             | -             |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.19   | 50,447.34     | 19,234.03     |
| 5. 利息支出                |            | 2,382,964.78  | 490,557.75    |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 2,382,964.78  | 490,557.75    |
| 6. 税金及附加               |            | 464.78        | 8,083.62      |
| 7. 其他费用                | 6.4.7.20   | 129,738.35    | 108,107.60    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 25,735,206.59 | 3,869,023.65  |
| 减：所得税费用                |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 25,735,206.59 | 3,869,023.65  |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |       |         |
|----|---------------------------------------|-------|---------|
|    | 实收基金                                  | 未分配利润 | 所有者权益合计 |

|                                        |                                            |                |                  |
|----------------------------------------|--------------------------------------------|----------------|------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 955,835,377.57                             | 57,559,857.41  | 1,013,395,234.98 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | 25,735,206.59  | 25,735,206.59    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 235,710,657.77                             | 14,391,637.07  | 250,102,294.84   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 235,798,706.97                             | 14,396,467.04  | 250,195,174.01   |
| 2. 基金赎回款                               | -88,049.20                                 | -4,829.97      | -92,879.17       |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                                          | -28,599,148.23 | -28,599,148.23   |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 1,191,546,035.34                           | 69,087,552.84  | 1,260,633,588.18 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                  |
|                                        | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 100,002,986.32                             | 1,113,443.65   | 101,116,429.97   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                          | 3,869,023.65   | 3,869,023.65     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 860,591,430.50                             | 39,353,873.77  | 899,945,304.27   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 863,515,468.69                             | 39,489,834.23  | 903,005,302.92   |
| 2. 基金赎回款                               | -2,924,038.19                              | -135,960.46    | -3,059,998.65    |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金                  | -                                          | -              | -                |

|                   |                |               |                  |
|-------------------|----------------|---------------|------------------|
| 净值变动（净值减少以“-”号填列） |                |               |                  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）   | 960,594,416.82 | 44,336,341.07 | 1,004,930,757.89 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>尤象都</u> | <u>尤象都</u> | <u>孙波</u> |
| 基金管理人负责人   | 主管会计工作负责人  | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前 15 个工作日、开放期内及开放期结束后 15 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制；在开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本

基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人太平基金管理有限公司于 2021 年 8 月 31 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况，以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税

试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

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

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|                |              |
|----------------|--------------|
| 活期存款           | 3,831,103.51 |
| 定期存款           | -            |
| 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           | -            |
| 合计             | 3,831,103.51 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                  |                  |
|---------------|------------------------|------------------|------------------|
|               | 成本                     | 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                  | 183,930,311.33   | 183,774,696.98   |
|               | 银行间市场                  | 1,320,395,297.73 | 1,322,732,000.00 |
|               | 合计                     | 1,504,325,609.06 | 1,506,506,696.98 |
| 资产支持证券        | -                      | -                | -                |
| 基金            | -                      | -                | -                |
| 其他            | -                      | -                | -                |
| 合计            | 1,504,325,609.06       | 1,506,506,696.98 | 2,181,087.92     |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------|
| 应收活期存款利息  | 1,611.53               |
| 应收定期存款利息  | -                      |
| 应收其他存款利息  | -                      |
| 应收结算备付金利息 | 88.20                  |

|            |               |
|------------|---------------|
| 应收债券利息     | 23,616,562.53 |
| 应收资产支持证券利息 | —             |
| 应收买入返售证券利息 | —             |
| 应收申购款利息    | —             |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —             |
| 应收出借证券利息   | —             |
| 其他         | 63.30         |
| 合计         | 23,618,325.56 |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | —                      |
| 银行间市场应付交易费用 | 30,056.26              |
| 合计          | 30,056.26              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 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   | —                      |
| 预提信息披露费     | 179,507.37             |
| 预提审计费       | 104,630.98             |
| 合计          | 284,138.35             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 955,835,377.57                        | 955,835,377.57   |
| 本期申购          | 235,798,706.97                        | 235,798,706.97   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -88,049.20                            | -88,049.20       |
| - 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           | 1,191,546,035.34                      | 1,191,546,035.34 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | 60,984,471.11  | -3,424,613.70 | 57,559,857.41  |
| 本期利润           | 23,163,973.74  | 2,571,232.85  | 25,735,206.59  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 15,010,678.86  | -619,041.79   | 14,391,637.07  |
| 其中：基金申购款       | 15,015,668.46  | -619,201.42   | 14,396,467.04  |
| 基金赎回款          | -4,989.60      | 159.63        | -4,829.97      |
| 本期已分配利润        | -28,599,148.23 | -             | -28,599,148.23 |
| 本期末            | 70,559,975.48  | -1,472,422.64 | 69,087,552.84  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 44,071.59                             |
| 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 | 7,881.08                              |
| 其他        | 705.81                                |
| 合计        | 52,658.48                             |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 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>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 3,083,012,077.76           |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,048,226,754.25           |
| 减：应收利息总额                | 30,615,430.21              |
| 买卖债券差价收入                | 4,169,893.30               |

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 2,571,232.85                          |
| 股票投资                       | -                                     |
| 债券投资                       | 2,571,232.85                          |
| 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变动<br>产生的预估增值税 | -                                     |
| 合计                         | 2,571,232.85                          |

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,322.34                              |
| 银行间市场交易费用 | 49,125.00                             |
| 合计        | 50,447.34                             |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 44,630.98                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 债券账户维护费 | 25,600.00                             |
| 合计      | 129,738.35                            |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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、登记机构 |
| 江苏银行股份有限公司（“江苏银行”） | 基金托管人             |

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,796,356.42                          | 297,276.61                                 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 226,424.47                            | 38,909.12                                  |

注：支付基金管理人太平基金的管理人报酬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。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 598,785.42                            | 99,092.20                                  |

注：支付基金托管人江苏银行的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。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值× 0.10%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 6.4.10.4 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

#### 6.4.10.4.1 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

#### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人于本报告期内及上年度可比期间内未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                              | 上年度末<br>2020 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 (%) |
| 江苏银行  | 478,101,931.54         | 40.1245                      | 478,101,931.54           | 50.0193                      |

##### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |           |
|------------|---------------------------------------|-----------|--------------------------------------------|-----------|
|            | 期末余额                                  | 当期利息收入    | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 江苏银行股份有限公司 | 3,831,103.51                          | 44,071.59 | 10,204,406.37                              | 52,893.69 |

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

##### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日 | 除息日 |      | 每 10 份<br>基金份<br>额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投资<br>形式<br>发放总<br>额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|-----------|-----|------|---------------------------|---------------|-----------------------|---------------|----|
|    |           | 场内  | 场外   |                           |               |                       |               |    |
| 1  | 2021      | -   | 2021 | 0.2500                    | 28,599,065.63 | 82.60                 | 28,599,148.23 | -  |

|    |               |   |               |        |               |       |               |   |
|----|---------------|---|---------------|--------|---------------|-------|---------------|---|
|    | 年 4 月<br>20 日 |   | 年 4 月<br>20 日 |        |               |       |               |   |
| 合计 | -             | - | -             | 0.2500 | 28,599,065.63 | 82.60 | 28,599,148.23 | - |

#### 6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 269,899,392.05 元, 是以如下债券作为抵押:

金额单位: 人民币元

| 债券代码      | 债券名称          | 回购到期日          | 期末估值单价 | 数量(张)     | 期末估值总额         |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 190203    | 19 国开 03      | 2021 年 7 月 1 日 | 100.78 | 520,000   | 52,405,600.00  |
| 200215    | 20 国开 15      | 2021 年 7 月 1 日 | 101.39 | 39,000    | 3,954,210.00   |
| 200313    | 20 进出 13      | 2021 年 7 月 1 日 | 100.91 | 600,000   | 60,546,000.00  |
| 112108047 | 21 中信银行 CD047 | 2021 年 7 月 6 日 | 97.11  | 600,000   | 58,266,000.00  |
| 112110128 | 21 兴业银行 CD128 | 2021 年 7 月 6 日 | 97.11  | 487,000   | 47,292,570.00  |
| 合计        |               |                |        | 2,246,000 | 222,464,380.00 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 54,000,000.00 元, 于 2021 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

### 6.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行江苏银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 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>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 40,016,000.00          | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 50,075,000.00          | 370,452,539.20           |
| 合计     | 90,091,000.00          | 370,452,539.20           |

注：未评级债券为国券、政策性银行债、证券公司债、地方政府债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末及上年末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 174,842,000.00         | 175,966,000.00           |
| 合计     | 174,842,000.00         | 175,966,000.00           |

#### 6.4.13.2.4 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>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 753,277,802.40         | 526,422,732.00           |
| AAA 以下 | 80,528,000.00          | 40,616,000.00            |
| 未评级    | 407,767,894.58         | 431,068,356.25           |
| 合计     | 1,241,573,696.98       | 998,107,088.25           |

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末及上年末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

### 6.4.13.3 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 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 269,899,392.05 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)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。

#### 6.4.13.3.1 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》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%(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附注 6.4.12。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%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，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 2021 年 6 月 30 日，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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 | 1 年以内          | 1-5 年          | 5 年以上          | 不计息           | 合计               |
|------------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 资产                     |                |                |                |               |                  |
| 银行存款                   | 3,831,103.51   | -              | -              | -             | 3,831,103.51     |
| 结算备付金                  | 196,143.63     | -              | -              | -             | 196,143.63       |
| 存出保证金                  | 140,694.99     | -              | -              | -             | 140,694.99       |
| 交易性金融资产                | 467,199,000.00 | 854,228,780.48 | 185,078,916.50 | -             | 1,506,506,696.98 |
| 应收利息                   | -              | -              | -              | 23,618,325.56 | 23,618,325.56    |
| 资产总计                   | 471,366,942.13 | 854,228,780.48 | 185,078,916.50 | 23,618,325.56 | 1,534,292,964.67 |
| 负债                     |                |                |                |               |                  |
| 应付管理人报酬                | -              | -              | -              | 310,214.79    | 310,214.79       |
| 应付托管费                  | -              | -              | -              | 103,404.92    | 103,404.92       |

|                          |                  |                |                |               |                  |
|--------------------------|------------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 应付证券清算款                  | -                | -              | -              | 3,006,916.97  | 3,006,916.97     |
| 卖出回购金融资产款                | 269,899,392.05   | -              | -              | -             | 269,899,392.05   |
| 应付交易费用                   | -                | -              | -              | 30,056.26     | 30,056.26        |
| 应付利息                     | -                | -              | -              | 25,253.15     | 25,253.15        |
| 其他负债                     | -                | -              | -              | 284,138.35    | 284,138.35       |
| 负债总计                     | 269,899,392.05   | -              | -              | 3,759,984.44  | 273,659,376.49   |
| 利率敏感度缺口                  | 201,467,550.08   | 854,228,780.48 | 185,078,916.50 | 19,858,341.12 | 1,260,633,588.18 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内            | 1-5 年          | 5 年以上          | 不计息           | 合计               |
| 资产                       |                  |                |                |               |                  |
| 银行存款                     | 11,575,008.83    | -              | -              | -             | 11,575,008.83    |
| 结算备付金                    | 10,841.23        | -              | -              | -             | 10,841.23        |
| 存出保证金                    | 8,339.41         | -              | -              | -             | 8,339.41         |
| 交易性金融资产                  | 989,140,777.10   | 545,312,353.85 | 10,072,496.50  | -             | 1,544,525,627.45 |
| 应收利息                     | -                | -              | -              | 14,215,874.98 | 14,215,874.98    |
| 资产总计                     | 1,000,734,966.57 | 545,312,353.85 | 10,072,496.50  | 14,215,874.98 | 1,570,335,691.90 |
| 负债                       |                  |                |                |               |                  |
| 卖出回购金融资产款                | 547,840,796.40   | -              | -              | -             | 547,840,796.40   |
| 应付证券清算款                  | -                | -              | -              | 8,447,416.28  | 8,447,416.28     |
| 应付管理人报酬                  | -                | -              | -              | 256,254.06    | 256,254.06       |
| 应付托管费                    | -                | -              | -              | 85,418.01     | 85,418.01        |
| 应付交易费用                   | -                | -              | -              | 48,243.15     | 48,243.15        |
| 应付利息                     | -                | -              | -              | 82,329.02     | 82,329.02        |
| 其他负债                     | -                | -              | -              | 180,000.00    | 180,000.00       |
| 负债总计                     | 547,840,796.40   | -              | -              | 9,099,660.52  | 556,940,456.92   |
| 利率敏感度缺口                  | 452,894,170.17   | 545,312,353.85 | 10,072,496.50  | 5,116,214.46  | 1,013,395,234.98 |

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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                |                        |  |
| 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（2021 年 6 月 30 日）                              | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |  |

|    |               |                   |                  |
|----|---------------|-------------------|------------------|
| 分析 | 市场利率下降 25 个基点 | 13, 581, 742. 69  | 7, 963, 429. 17  |
|    | 市场利率上升 25 个基点 | -13, 352, 187. 87 | -7, 848, 050. 35 |

#### 6. 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。

#### 6. 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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6. 4. 14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7. 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            | 1, 506, 506, 696. 98 | 98. 19        |
|    | 其中：债券             | 1, 506, 506, 696. 98 | 98. 19        |
|    | 资产支持证券            | —                    | —             |
| 4  | 贵金属投资             | —                    | —             |
| 5  | 金融衍生品投资           | —                    | —             |
| 6  | 买入返售金融资产          | —                    | —             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —                    | —             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 4, 027, 247. 14      | 0. 26         |
| 8  | 其他各项资产            | 23, 759, 020. 55     | 1. 55         |
| 9  | 合计                | 1, 534, 292, 964. 67 | 100. 00       |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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境内股票。

### 7.2.2 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。

## 7.3 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。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.5 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      | 50,073,322.28    | 3.97          |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 1,278,832,635.10 | 101.44        |
|    | 其中：政策性金融债 | 356,157,635.10   | 28.25         |
| 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      | 174,842,000.00   | 13.87         |
| 9  | 其他        | 2,758,739.60     | 0.22          |
| 10 | 合计        | 1,506,506,696.98 | 119.50        |

## 7.6 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  | 190203    | 19 国开 03 | 1,100,000 | 110,858,000.00 | 8.79          |
| 2  | 180322    | 18 进出 22 | 1,000,000 | 102,880,000.00 | 8.16          |
| 3  | 200313    | 20 进出 13 | 600,000   | 60,546,000.00  | 4.80          |
| 4  | 112108047 | 21 中信银行  | 600,000   | 58,266,000.00  | 4.62          |

|   |           |                  |         |               |      |
|---|-----------|------------------|---------|---------------|------|
|   |           | CD047            |         |               |      |
| 5 | 112110128 | 21 兴业银行<br>CD128 | 600,000 | 58,266,000.00 | 4.62 |

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.10.1 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。

##### 7.10.2 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。

##### 7.10.3 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。

#### 7.11 投资组合报告附注

##### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体中是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国金证券股份有限公司、中信银行股份有限公司、国家开发银行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。

##### 7.11.2 基金投资的前十名股票中是否超出基金合同规定备选股票库

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备选股票库的情形。

##### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 140,694.99    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 23,618,325.56 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | -             |
| 9 | 合计 | 23,759,020.55 |

#### 7.11.4 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。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在前十名股票中存在流通受限情况。

#### 7.11.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构            |                |            |                |
|--------------|---------------|------------------|----------------|------------|----------------|
|              |               | 机构投资者            |                | 个人投资者      |                |
|              |               | 持有份额             | 占总份额比<br>例 (%) | 持有份额       | 占总份额比<br>例 (%) |
| 267          | 4,462,719.23  | 1,191,414,721.04 | 99.9890        | 131,314.30 | 0.0110         |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1,628.15   | 0.0001       |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10               |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                  |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2019 年 6 月 27 日) 基金份额总额 | 200,002,007.22   |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 955,835,377.57   |
| 本报告期基金总申购份额                      | 235,798,706.97   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 88,049.20        |
| 本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)        | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                     | 1,191,546,035.34 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

本报告期，基金管理人无重大人事变动情况。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，江苏银行股份有限公司资产托管部负责人变更为周宏先生。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 华泰证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

(1) 市场形象及财务状况良好。

(2) 经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的

处罚。

(3) 内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

(4) 研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

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

## 2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本期未新增席位

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 734,083,314.52 | 100.00%      | 774,400,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                           | 法定披露方式       | 法定披露日期           |
|----|------------------------------------------------|--------------|------------------|
| 1  | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 06 月 22 日 |
| 2  | 关于太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换等业务的公告       | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 01 月 14 日 |
| 3  | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 2020 年年度报告                | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 03 月 25 日 |
| 4  | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告            | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 01 月 22 日 |
| 5  | 太平基金管理有限公司关于太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金开放期调整的公告       | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 01 月 28 日 |
| 6  | 关于太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换等业务的公告       | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 04 月 27 日 |
| 7  | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 1 号       | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 04 月 20 日 |
| 8  | 太平基金管理有限公司关于太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金               | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 04 月 19 日 |

|    |                                                  |              |                  |
|----|--------------------------------------------------|--------------|------------------|
|    | 分红公告                                             |              |                  |
| 9  | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新                   | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 04 月 20 日 |
| 10 | 关于太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金开放期调整的公告                   | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 05 月 15 日 |
| 11 | 太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告              | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 04 月 22 日 |
| 12 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加民商基金销售（上海）有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 04 月 14 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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              | 20210101--20210103      | 477,700,325.11 | -              | 477,700,325.11 | 0.00           | 0        |
| 机构                                                                                                                                         | 2              | 20210104--20210630      | -              | 477,700,325.11 | -              | 477,700,325.11 | 40.0908  |
| 机构                                                                                                                                         | 3              | 20210101--20210630      | 478,101,931.54 | -              | -              | 478,101,931.54 | 40.1245  |
| 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。 |                |                         |                |                |                |                |          |

注：本章节中申购份额/赎回份额统计包含非交易过户业务。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

|   |
|---|
| 无 |
|---|

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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、《太平恒利纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平恒利纯债债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平恒利纯债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

## 12.2 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）

## 12.3 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

2021 年 8 月 31 日