

太平基金管理有限公司

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）摘要
（2020年第1号）

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

二〇二〇年四月

重要提示

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”）2019年5月29日经中国证监会证监许可2019【946】号文注册募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

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。

投资有风险，投资者在投资本基金前，应当认真、仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书等基金法律文件，全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，理性判断市场，谨慎、独立做出投资决策，承担基金投资中出现的各类风险，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构认/申购和赎回本基金。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来业绩表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金资产净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金在募集成立时及运作过程中，单一投资者持有的基金份额占本基金总份额的比例不得达到或超过**50%**（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外）。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为**2020年3月13日**，并根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》对基金信息披露相关条款更新。有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日期：2019年6月27日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：太平基金管理有限公司

住所：中国上海市虹口区邯郸路135号5幢101室

办公地址：中国上海浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室

法定代表人：范宇

设立日期：2013年1月23日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会 证监许可[2012]1719号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币4亿元

存续期限：持续经营

联系人：陈宏

客户服务电话：400-028-8699/021-61560999

传真：021-38556751

股权结构：

股东名称	持股比例
太平资产管理有限公司	91.50%
安石投资管理有限公司	8.50%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

范宇先生，董事长。中共党员，法学硕士，具有证券投资基金从业资格。曾任职于中国平安保险公司、中国证监会、中国证券登记结算有限责任公司。现任中国太平保险集团有限责任公司（中国太平保险集团<香港>有限公司）投资管理部副总经理、本基金管理人董事长。

李宏先生，董事。金融学本科。现任太平资产管理有限公司副总经理。曾任上海财政证券公司肇嘉浜路营业部总经理；上海证券有限责任公司证券投资总部总经理；太平资产管理有限公司投资管理部总经理、投资总监、助理总经理兼投资总监等职。

徐钢先生，董事。中共党员，经济学硕士，高级经济师。现任太平资产管理有限公司副总经理。曾任中国人寿保险（集团）公司投资管理部资产配置处、股权管理处负责人；太平资产管理有限公司股权投资事业部总经理、组合管理部总经理、创新发展部副总经理（主持工作）、助理总经理等职。

吴东先生,董事。中共党员，法学硕士，具有证券投资基金从业资格、仲裁员资格、律师资格。现任本公司副总经理、首席信息官。曾任上海市司法局办公室副主任；中国人寿保险股份有限公司上海分公司内控合规部总经理；中国人寿保险股份有限公司上海分公司宝山支公司总经理；太平资产管理有限公司风险管理部/项目评审部副总经理（部门总经理级）、监察部总经理、风险管理及合规部总经理等职。

周捷先生，董事。工学学士，工商管理硕士。具有证券投资基金从业资格。现任中原证券股份有限公司上海分公司总经理。曾任中州蓝海投资管理有限公司总经理，中鼎开源创业投资管理公司董事长、总经理，中原证券股份有限公司办公室副主任、主任、财富管理中心总经理，河南华证金融投资咨询公司研究员，深圳宝源期货郑州办事处经理，君安证券资产管理部投资经理等职。

Thomas Adam Shippey 先生，董事。英国阿斯顿大学国际商务和德语学士。现任安石集团战略发展总监兼安石集团财务总监。曾任普华永道会计师事务所注册会计师，瑞银集团任执行董事职务。

胡志浩先生，独立董事。中共党员，金融学博士。现任国家金融与发展实验室全球经济与金融研究中心主任。曾任职于中国社会科学院金融研究所、国家金融与发展实验室。

赵然女士，独立董事。经济学博士。现任河南省社科院金融财贸所负责人、副研究员，《河南金融发展报告暨河南金融蓝皮书》副主编。曾任职于跨国公司、

投资银行等相关企业。

于春海先生，独立董事。经济学博士。现任中国人民大学经济学院国际经济系主任、中国人民大学国家发展与战略研究院特聘研究员、中国特色社会主义经济建设协同创新中心研究员、中信改革发展研究院资深研究员及瞭望智库入驻专家。曾任职于中国航天工业总公司第三研究院第三设计部任助理工程师。

2、监事会成员

陈沫先生，监事会主席。民革党员，大专。现任太平资产管理有限公司信息技术部总经理。曾任职于太平人寿保险公司，曾任太平资产管理有限公司运营保障部副总经理、信息技术部副总经理、运营管理部副总经理等职。

曹燕萍女士，监事。中共党员，经济学硕士。现任太平资产管理有限公司权益投资部总经理。曾任申银万国证券研究所经理助理、高级研究员、能源小组组长，海富通基金管理有限公司高级研究员、绝对收益组基金经理，国金证券研究所研究总监；太平资产管理有限公司研究部总经理等职。

杨峰先生，监事。工程硕士，高级经济师。现任中原证券股份有限公司董事会办公室主任。曾任河南投资集团发展计划部业务经理、河南投资集团发展计划部高级业务经理、郑州拓洋实业有限公司总经理助理、河南投资集团担保有限公司副总经理、河南投资集团有限公司发展计划部副主任、中鼎开源创业投资管理有限公司总经理、中鼎开源创业投资管理有限公司董事长等职务。

王伟先生，职工监事。中共党员，金融学博士。具有证券投资基金从业资格。现任本公司研究部副总监。曾任太平养老保险有限公司受托管理部室经理；中国太平保险集团投资管理部经理；太平石化金融租赁有限责任公司综合管理部总经理助理、战略规划部助理总经理；太平基金管理有限公司研究发展部资深研究员、综合管理部副总监。

陈新先生，职工监事。中共党员，工商管理硕士。具有证券投资基金从业资格。现任本公司信息技术部总监。曾任丹东电子研究设计院研究室主任；丹东国际信托投资有限公司证券营业部IT工程师；华泰资管资深IT工程师；永诚保险资管信息管理部总经理。

3、公司高级管理人员

范宇先生，董事长。中共党员，法学硕士，具有证券投资基金从业资格。曾任职于中国平安保险公司、中国证监会、中国证券登记结算有限责任公司。现任中国太平保险集团有限责任公司（中国太平保险集团<香港>有限公司）投资管理部副总经理、本基金管理人董事长。

岳冲先生，督察长。中共党员，法律硕士。曾任职于中国海关、中国证监会、太平基金管理有限公司副总经理。现任本基金管理人督察长。

吴东先生，副总经理。中共党员法学硕士，具有证券投资基金从业资格、仲裁员资格、律师资格。曾任上海市司法局办公室副主任；中国人寿保险股份有限公司上海分公司内控合规部总经理；中国人寿保险股份有限公司上海分公司宝山支公司总经理；太平资产管理有限公司风险管理部/项目评审部副总经理（部门总经理级）、监察部总经理、风险管理及合规部总经理等职。现任本基金管理人副总经理。

4、本基金基金经理

吴超先生，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。7年证券基金行业从业经验。2013年5月起曾任职于西部证券股份有限公司固定收益部和上海金懿投资有限公司担任固定收益部投资经理、投资总监等职。2017年3月加入本公司担任固定收益部基金经理助理，从事投资相关工作。2018年2月12日起担任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。2019年3月25日任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2019年6月27日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。

5、投资决策委员会成员的姓名、职务

本基金投资采取集体决策制度，投资决策委员会成员的姓名及职务如下：

投资决策委员会主席：副总经理吴东先生（代为履行总经理职务）。

投资决策委员会成员：总经理助理宋磊先生、权益投资部梁鹏先生、权益投资部徐磊先生、权益投资部林开盛先生、固定收益投资部陈晓女士、交易部吴士彬先生、权益投资部常璐先生。

三、基金托管人

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：江苏银行股份有限公司（简称：江苏银行）

公司法定英文名称：BANK OF JIANGSU CO.,LTD

法定代表人：夏平

住所：江苏省南京市中华路 26 号

办公地址：江苏省南京市中华路 26 号

邮政编码：210005

成立时间：2007 年 1 月 22 日

注册资本：115.44 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监许可【2014】619 号

联系人：蔡越

电话：025-58588112

（二）主要人员情况

江苏银行托管业务条线现有员工63名，来自于基金、券商、托管行等不同的行业，具有会计、金融、法律、IT等不同的专业知识背景，团队成员具有较高的专业知识水平、良好的服务意识、科学严谨的态度；部门管理层有20 年以上金融从业经验，精通国内外证券市场的运作。

（三）基金托管业务经营情况

2014 年，江苏银行先后获得基金托管业务资格及保险资金托管业务资格。江苏银行依靠严密科学的风险管理和内部控制体系以及先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、

高效、专业的托管服务。目前江苏银行的托管业务产品线已涵盖公募基金、信托计划、基金专户、基金子公司专项资管计划、券商资管计划、产业基金、私募投资基金、QDII 专户资产等。江苏银行将在现有的基础上开拓创新继续完善各类托管产品线。江苏银行同时可以为各类客户提供提供现金管理、绩效评估、风险管理等个性化的托管增值服务。

四、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

名称：太平基金管理有限公司

住所：中国上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室

办公地址：中国上海浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 10 楼 1004 室

法定代表人：范宇

联系人：陈宏

客户服务电话：400-028-8699/021-61560999

传真：021-38556751

公司网址：www.taipingfund.com.cn

2、其他销售机构

（1）中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

联系电话：010-60833754

传真：021-60819988

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

（2）申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

联系电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

（3）申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

联系电话：0991-2307105/13579978889

传真：0991-2301927

客户服务电话：4008000562

网址：www.swhysc.com

（4）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期北座）

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：马静懿

联系电话：010-60838888

传真：010-60833739

客户服务电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

（5）中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

联系人：孙秋月

联系电话：0532-85022026

传真：0532-68722193

客户服务电话：95548

网址：www.citicssd.com

（6）中信证券华南股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19、20 层

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19、20 层

法定代表人：胡伏云

联系人：梁微

联系电话：(020)88836999

客服电话：95396

传真：020-88836984

网址：www.gzs.com.cn

（7）长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

法定代表人：曹宏

联系人：梁浩

联系电话：0755-83530715

传真：0755-83515567

客户服务电话：400-6666888 95514

网址：www.cgws.com

（8）江苏汇林保大基金销售有限公司

住所：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

联系人：林伊灵

联系电话：025-66046166-810

传真：025-56878016

客户服务电话：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

（9）上海中正达广基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

联系人：戴珉微

联系电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

客户服务电话：4006767523

网址：www.zhongzhengfund.com

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

（二）登记机构

名称：太平基金管理有限公司

住所：中国上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室

办公地址：中国上海浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

法定代表人：范宇

联系人：孙波

联系电话：021-38556708

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市海华永泰律师事务所

住所：上海市华阳路 112 号 2 号楼东虹桥法律服务园区 302 室

办公地址：上海市东方路 69 号裕景国际商务广场 A 座 15 层

负责人：张诚

经办律师：张兰、梁丽金

联系人：张兰

联系电话：021-5877 3177

传真：021-5877 3268

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：薛竞、金诗涛

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：金诗涛

五、基金的名称

太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金

六、基金的类型

债券型基金

七、基金的投资目标

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。

八、基金的投资方向

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。

基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资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投资比例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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

九、基金的投资策略

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。

1、资产配置策略

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。

2、久期策略

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，以实现对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。

3、收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的依据之一，本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配。本基金将通过对收益率曲线变化的预测，适时采用子弹式、杠铃或梯形策略构造组合，并进行动态调整。

4、骑乘策略

本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。这一策略即通过对收益率曲线的分析，在可选的目标久期区间买入期限位于收益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。

5、息差策略

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。

6、债券选择策略

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。

7、资产支持证券投资策略

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。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或指数编制单位停止编制该指数、更改指数名称，或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征

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。

十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 8 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。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 12 月 31 日，本报告中财务资料未经审计。

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	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	150,044,638.70	98.31
	其中：债券	150,044,638.70	98.31
	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	425,161.54	0.28
8	其他资产	2,155,598.78	1.41
9	合计	152,625,399.02	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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。

3. 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

本基金本报告期末未持有股票。

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	1,856,000.00	1.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,159,890.00	8.07

	其中：政策性金融债	154,290.00	0.15
4	企业债券	19,828,780.00	19.61
5	企业短期融资券	36,940,000.00	36.53
6	中期票据	73,549,900.00	72.74
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,706,000.00	9.60
9	其他	4,068.70	-
10	合计	150,044,638.70	148.39

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	111912131	19 北京银行 CD131	100,000	9,706,000.00	9.60
2	101800522	18 苏交通 MTN001	80,000	8,190,400.00	8.10
3	101578005	15 京首钢 MTN001	80,000	8,133,600.00	8.04
4	101754024	17 河钢集 MTN002	80,000	8,094,400.00	8.01
5	155159	19CHNE01	80,000	8,036,000.00	7.95

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

11. 投资组合报告附注

本基金投资的前十名证券的发行主体或其分支机构中，北京银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、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。

除上述情形外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责处罚的情况。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,861.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,150,737.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,155,598.78

（4）报告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。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

十三、基金的业绩

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财产，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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金招募说明书。

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
2019年6月27日至2019年12月31日	1.11%	0.03%	1.13%	0.04%	-0.02%	-0.01%
成立至今	1.11%	0.03%	1.13%	0.04%	-0.02%	-0.01%

注：本基金成立于 2019 年 6 月 27 日。

十四、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的账户开户及维护费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人依据与基金管理人约定的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人依据与基金管理人约定的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、上述“（一）基金费用的种类”中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人根据基金管理人指令并参照行业惯例从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、基金合同生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的规定，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人于 2019 年 6 月 15 日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“重要提示”部分明确了更新招募说明书内容的截止日期、财务数据的截止日期。

2、对“第三部分 基金管理人”的内容进行了更新。

3、对“第四部分 基金托管人”的内容进行了更新。

4、对“第五部分 相关服务机构”的内容进行了更新。

5、对“第六部分 基金的募集”的内容进行了更新。

6、对“第七部分 基金合同的生效”的内容进行了更新。

7、对“第九部分 基金的投资”的内容进行了更新。

8、对“第十部分 基金的业绩”的内容进行了更新。

9、对“第二十二部份 其他应披露事项”的内容进行了更新。

以及其他根据 2019 年 7 月 26 日颁布的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》对基金信息披露的相关条款进行了更新

太平基金管理有限公司

二〇二〇年四月二十七日