

太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 08 月 07 日（基金合同生效日）起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	37

8.1 期末基金资产组合情况	37
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	38
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	39
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	39
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
8.11 投资组合报告附注	39
§ 9 基金份额持有人信息	40
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	40
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	40
§ 10 开放式基金份额变动	40
§ 11 重大事件揭示	41
11.1 基金份额持有人大会决议	41
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	41
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
11.4 基金投资策略的改变	42
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
11.8 其他重大事件	43
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	43
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	43
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 13 备查文件目录	44
13.1 备查文件目录	44
13.2 存放地点	44
13.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	太平恒泽 63 个月定开
基金主代码	009533
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 7 日
基金管理人	太平基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,000,016,404.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，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类工具，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	1、封闭期投资策略 （1）封闭期配置策略 本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。 基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置、变现。 （2）信用债投资策略 本基金由于封闭期内采用买入持有到期投资策略，因此，个券精选是本基金投资策略的重要组成部分。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源。本基金将在太平基金内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，根据对宏观经济形势、发行人公司所在行业状况、以及公司自身在行业内的竞争力、公司财务状况和现金流状况、公司治理等信息，进一步结合债券发行具体条款对债券进行分析，评估信用风险溢价，发掘具备相对价值的个券。 为控制本基金的信用风险，本基金将定期或不定期对所投债券的信用资质和发行人的偿付能力进行评估。对于存在信用风险隐患的发行人所发行的债券，及时制定风险处置预案。封闭期内，如本基金持有债券的信用风险显著增加时，为减少信用损失，本基金有权对该债券进行处置、变现。 （3）放大策略

	本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。 为控制风险，本基金的杠杆比例在每个封闭期内原则上保持不变，但是在回购利率过高、流动性不足、或者市场状况不宜采用放大策略等情况下，基金管理人可以调整杠杆比例或者不进行杠杆放大。 （4）资产支持证券投资策略 资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 （5）封闭期现金管理策略 在每个封闭期内完成组合的构建之前，本基金将根据届时的市场环境对组合的现金头寸进行管理，选择到期日（或回售日）在建仓期之内的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资，并采用买入持有到期投资策略。 由于在建仓期本基金的投资难以做到与封闭期剩余期限完美匹配，因此可能存在持有的部分投资品种在封闭期结束前到期兑付本息的情形。另一方面，本基金持有的部分投资品种的付息也将增加基金的现金头寸。对于现金头寸，本基金将根据届时的市场环境和封闭期剩余期限，选择到期日（或回售日）在封闭期结束之前的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资或进行基金现金分红。 2、开放期投资策略 开放期内，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。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年定期存款利率（税后）+1%。 三年定期存款利率采用每个封闭期起始日中国人民银行公布的金融机构人民币三年存款基准利率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，一般而言，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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵霖	陆志俊
	联系电话	021-38556613	95559
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-61560999/400-028-8699	95559
传真		021-38556677	021-62701216

注册地址	上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室	中国(上海)自贸试验区银城中路 188 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	中国(上海)长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	范宇	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	太平基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 8 月 7 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	101,551,049.15
本期利润	101,551,049.15
加权平均基金份额本期利润	0.0127
本期加权平均净值利润率	1.26%
本期基金份额净值增长率	1.27%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	101,551,049.15
期末可供分配基金份额利润	0.0127
期末基金资产净值	8,101,567,453.35
期末基金份额净值	1.0127
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	1.27%

注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 8 月 07 日，截至本报告期末基金成立未满一年。

2、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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

低于所列数字。

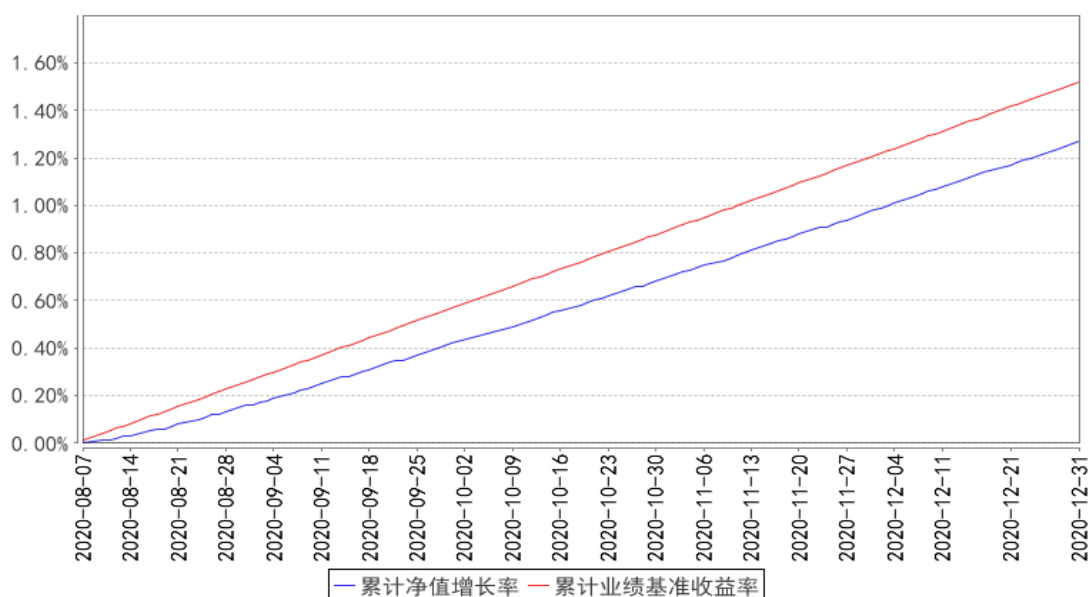
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.85%	0.01%	0.95%	0.01%	-0.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.27%	0.01%	1.52%	0.01%	-0.25%	0.00%

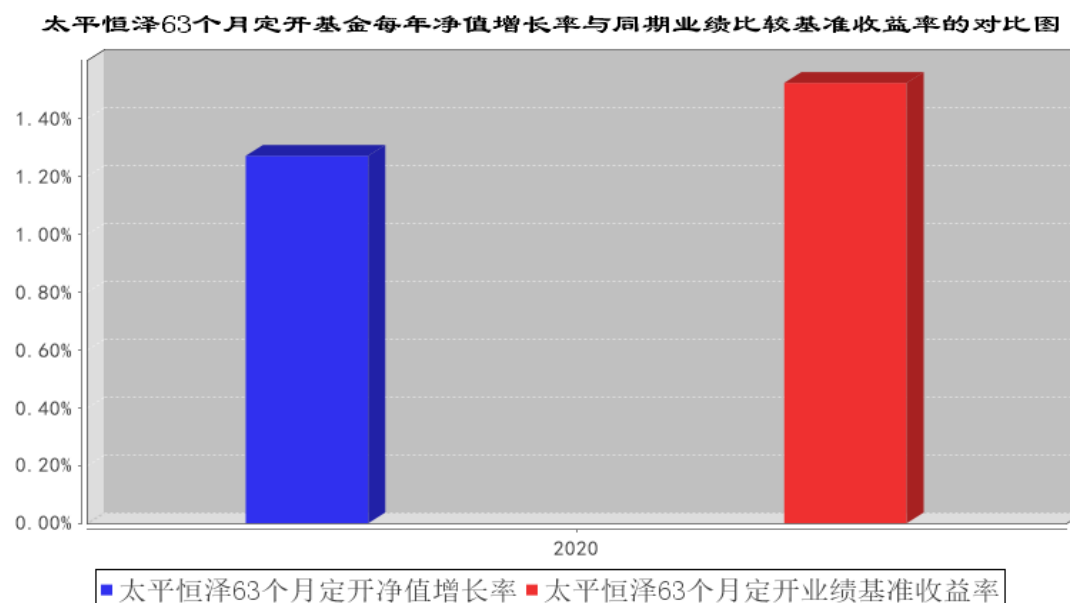
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

太平恒泽63个月定开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期为 2020 年 8 月 7 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未
满一年。本基金的建仓期为基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

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



注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 8 月 7 日，至本报告期末未满 5 年。

2、合同生效按当年实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§ 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 16 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。

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、太平恒安三个月定期开放债券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券投资基金基金经理、太平恒久纯债债券型证券投资基金基金经理	2020 年 08 月 07 日	-	7 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。

注：1、基金经理的任职日期和离任日期一般情况下指公司对外公告之日；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券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 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易

成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年债券市场波动较大，收益率先大幅下行触及近两年低点随后大幅反弹。太平恒泽在 2020 年 8 月成立，在三季度至四季度初完成建仓，整体建仓时点在全年来看相对较好。本组合投资策略为主要匹配封闭期限的利率债并加以杠杆增加收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平恒泽 63 个月定开的份额净值增长率为 1.27%，同期业绩比较基准收益率为 1.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年对资本市场而言，疫情+政策是主线。债市整体先扬后抑，1-4 月，受新冠疫情影响，国内外宽松不断，债牛开启；5-7 月国内疫情得到控制、海外疫情持续发酵，货币政策由宽货币宽信用，到宽信用防风险，债市从牛陡走向熊平（利率熊而信用牛）；8 月以来，货币回归中性，债市熊平；11 月中旬以来，超预期信用违约事件爆发，央行超预期操作 MLF 等，债市出现反弹。

展望 2021 年预计经济基本面将持续复苏，疫情也将因为疫苗的出现将在全球范围内得到有效控制。在 2021 年一二季度由于去年的低基数效应经济名义同比增速将会较高，对债市带来一定的压力，同时货币政策逆周期调节措施将逐步退出，货币环境的边际收敛在经济上行阶段对债券市场也有较大的压力。社融增速在 2020 年底已经触及近期高点，随着社融增速、M2 增速的下行整体市场将迎来短暂的紧信用、紧货币环境。预计 2021 年下半年经济有一定的下行压力，届时国内政策可能会迎来边际微调。预计 2021 年债券市场震荡概率较大，维持高评级信用债以及利率债表现好于整体市场的观点。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

在内控制度建设方面，公司持续完善内控制度建设，并时刻关注法规的新变化、结合行业发展的新动态、围绕业务开展的新需要，适时组织更新相关业务制度。在公司合规文化建设方面，公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，不断增强全体员工的合规自觉与风控意识，为公司业务的规范开展和健康发展创造良好的内控环境。在稽核检查方面，公司稽核风控部在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对各项业务活动进行

监督、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，定期对各类业务开展情况以及公司整体运营情况进行覆盖全面、重点突出的检查、总结和反馈，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》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。公司估值委员会成员由主席负责，成员包括稽核风控部门负责人、量化投资部门负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关约定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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, 太平基金管理有限公司在太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金投资运作、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、基金收益分配等问题上, 托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内, 由太平基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 22195 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“太平恒泽 63 个月定开债券基金”)的财务报表, 包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表, 2020 年 8 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二) 我们的意见 我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了太平恒泽 63 个月定开债券基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 8 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于太平恒泽 63 个月定开债券基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。

强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	太平恒泽 63 个月定开债券基金的基金管理人太平基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估太平恒泽 63 个月定开债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算太平恒泽 63 个月定开债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督太平恒泽 63 个月定开债券基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对太平恒泽 63 个月定开债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致太平恒泽

	63 个月定开债券基金不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	陈熹	金诗涛
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2021 年 03 月 23 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日: 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	7.4.7.1	18,746,950.52
结算备付金		3,264,584.69
存出保证金		1,040.72
交易性金融资产	7.4.7.2	-
其中: 股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	59,945,149.97
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	139,847,210.05
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	10,339,566,857.12
资产总计		10,561,371,793.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负 债:		

短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		2,439,845,739.01
应付证券清算款		17,467,822.22
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,027,742.28
应付托管费		342,580.78
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	80,362.45
应交税费		-
应付利息		800,092.98
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	240,000.00
负债合计		2,459,804,339.72
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	8,000,016,404.20
未分配利润	7.4.7.10	101,551,049.15
所有者权益合计		8,101,567,453.35
负债和所有者权益总计		10,561,371,793.07

注：1. 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0127 元，基金份额总额 8,000,016,404.20 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间。

3. 资产负债表中其他资产为分类为持有至到期投资的债券投资。

7.2 利润表

会计主体：太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 8 月 7 日（基金合同生 效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		121,334,692.63
1. 利息收入		121,334,692.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,303,053.14
债券利息收入		113,586,171.16
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		6,445,468.33
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
减：二、费用		19,783,643.48
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,815,197.42
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,605,065.80
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.18	-
5. 利息支出		13,121,480.26
其中：卖出回购金融资产支出		13,121,480.26
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.19	241,900.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		101,551,049.15
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		101,551,049.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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）	8,000,016,404.20	-	8,000,016,404.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	101,551,049.15	101,551,049.15
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)			
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	8,000,016,404.20	101,551,049.15	8,101,567,453.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

太平恒泽 63 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[2020]791 号《关于准予太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,由太平基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平恒泽 63 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 8,000,016,403.45 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(2020)第 0646 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2020 年 8 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 8,000,016,404.20 份,其中认购资金利息折合 0.75 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金以 63 个月为一个封闭期。本基金第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日起至 63 个月后的月度对日的前一日,依此类推。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起或下一个封闭期开始前进入开放期,期间可以办理申购与赎回业

务。本基金每个开放期不少于 10 个工作日并且最长不超过 20 个工作日，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。如封闭期结束后或在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次一工作日起，继续计算该开放期时间，直至满足开放期的时间要求。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，本基金主要投资于债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款等)、同业存单、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金不投资股票、可转换债券、可交换债券。本基金所投信用债评级需在 AA+(含)以上的信用债，信用评级依照国内依法成立并拥有证券评级资质的评级机构出具的主体信用评级。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，本基金开放期开始前 3 个月、开放期以及开放期结束后的 3 个月内，本基金的债券资产的投资比例不受上述限制。开放期内，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，封闭期内不受上述 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。在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为：该封闭期起始日公布的三年定期存款利率(税后)+1%。

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 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 8 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业

会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 8 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 8 月 7 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及可供出售金融资产。

本基金采用买入持有至到期投资策略投资的债券投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。应收款项、持有至到期投资和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

对于应收款项、持有至到期投资和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产

发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

于持有至到期投资处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

持有至到期投资是否减值在很大程度上依赖于基金管理人的判断。本基金的基金管理人定期审阅持有至到期投资以评估其是否出现减值情况，并在出现减值情况时评估减值损失的具体金额。发生减值的客观证据包括评估日该金融工具可观察的市场价值出现严重下跌，发行方发生严重财务困难使该金融资产无法在活跃市场继续交易、无法履行合同条款(例如，无法按期偿付利息或本金)等。在进行判断的过程中，本基金的基金管理人需评估发生减值的客观证据对该项投资预计未来现金流的影响。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的

利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	18,746,950.52
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	18,746,950.52

7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末无交易性金融资产。

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	—	—
银行间市场	59,945,149.97	—
合计	59,945,149.97	—

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	5,794.70
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	1,616.01
应收债券利息	139,836,223.16
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	3,575.63
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	0.55
合计	139,847,210.05

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
其他应收款	—
待摊费用	—
持有至到期投资	10,339,566,857.12
合计	10,339,566,857.12

注：于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的持有至到期投资为债券投资，其中交易所市场债券 463,662,790.63 元，银行间市场债券 9,875,904,066.49 元。上述持有至到期投资均无需计提减值准备。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	80,362.45
合计	80,362.45

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	120,000.00
预提审计费	120,000.00
合计	240,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	8,000,016,404.20	8,000,016,404.20
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 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	8,000,016,404.20	8,000,016,404.20

注：1. 本基金自 2020 年 7 月 23 日至 2020 年 8 月 5 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 8,000,016,403.45 元。根据《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 0.75 元在本基金成立后，折算为 0.75 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金以定期开放方式运作，每个封闭期为自基金合同生效日(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起 63 个月的期间。本基金自封闭期结束之日的下一个工作日(含)起或下一个封闭期开始前进入开放期，每个开放期不少于 10 个工作日并且最长不超过 20 个工作日。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	101,551,049.15	-	101,551,049.15
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-	-	-
本期末	101,551,049.15	-	101,551,049.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	899,558.50
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	403,490.13
其他	4.51
合计	1,303,053.14

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动损益。

7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	120,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	—
债券账户维护费	1,500.00
开户费	400.00
合计	241,900.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
太平基金管理有限公司（“太平基金”）	基金管理人、基金销售机构、登记机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
太平资产管理有限公司（“太平资管”）	基金管理人的股东
安石投资管理有限公司（“安石投资”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,815,197.42
其中：支付销售机构的客户维护费	4.38

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 0.15%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 × 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,605,065.80

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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 × 0.05% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	630,154,852.32	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
交通银行	499,999,000.00	6.2500

7.4.10.5 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 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	18,746,950.52	899,558.50

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额 2,120,645,739.01 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
150314	15 进出 14	2021 年 1 月 4 日	102.18	8,230,000	840,927,877.25
200405	20 农发 05	2021 年 1 月 4 日	95.55	4,440,000	424,258,521.38
200405	20 农发 05	2021 年 1 月 5 日	95.55	1,400,000	133,775,209.44
150314	15 进出 14	2021 年 1 月 6 日	102.18	1,100,000	112,396,192.59
200405	20 农发 05	2021 年 1 月 6 日	95.55	7,850,000	750,096,710.09
合计				23,020,000	2,261,454,510.75

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 319,200,000.00 元，截至 2021 年 6 月 24 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，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。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内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 2020 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 2,439,845,739.01 元将在六个月以内到期到期且计息(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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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 7.4.12。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 2020 年 12 月 31 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 2020 年 12 月 31 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。

综合上述各项流动性指标的检测结果集流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好，无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过合理配置债券组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。本基金主要投资于固定利率类的固定品种，因此很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	18,746,950.52	-	-	-	18,746,950.52
结算备付金	3,264,584.69	-	-	-	3,264,584.69
存出保证金	1,040.72	-	-	-	1,040.72
买入返售金融资产	59,945,149.97	-	-	-	59,945,149.97
应收利息	-	-	-	139,847,210.05	139,847,210.05
其他资产	-	10,339,566,857.12	-	-	10,339,566,857.12
资产总计	81,957,725.90	10,339,566,857.12	-	139,847,210.05	10,561,371,793.07
负债					
卖出回购金融资产款	2,439,845,739.01	-	-	-	2,439,845,739.01
应付证券清算款	-	-	-	17,467,822.22	17,467,822.22
应付管理人报酬	-	-	-	1,027,742.28	1,027,742.28
应付托管费	-	-	-	342,580.78	342,580.78
应付交易费用	-	-	-	80,362.45	80,362.45
应付利息	-	-	-	800,092.98	800,092.98
其他负债	-	-	-	240,000.00	240,000.00
负债总计	2,439,845,739.01	-	-	19,958,600.71	2,459,804,339.72
利率敏感度缺口	-2,357,888,013.11	10,339,566,857.12	-	-119,888,609.34	8,101,567,453.35

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金对债券组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，因此市场利率变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

-(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、持有至到期投资和其他金融负债等。

除持有至到期投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面价值	公允价值
持有至到期投资	10,339,566,857.12	10,411,087,635.60

持有至到期投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场

交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于2020年12月31日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	10,339,566,857.12	97.90
	其中：债券	10,339,566,857.12	97.90
	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	59,945,149.97	0.57
	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	22,011,535.21	0.21
8	其他各项资产	139,848,250.77	1.32

9	合计	10,561,371,793.07	100.00
---	----	-------------------	--------

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期末未持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	126,815,257.31	1.57
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,212,751,599.81	126.06
	其中：政策性金融债	10,212,751,599.81	126.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,339,566,857.12	127.63

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200405	20 农发 05	36,700,000	3,506,821,561.84	43.29
2	150314	15 进出 14	26,750,000	2,733,271,046.97	33.74
3	150218	15 国开 18	8,200,000	830,943,334.20	10.26

4	200212	20 国开 12	8,200,000	818,032,597.37	10.10
5	200408	20 农发 08	7,400,000	738,302,306.76	9.11

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银河证券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。

8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内，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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,040.72
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	139,847,210.05
5	应收申购款	—

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	139,848,250.77

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期间的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 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 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
302	26,490,120.54	7,999,994,000.00	99.9997	22,404.20	0.0003

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	1.98	—

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 8 月 7 日) 基 金份额总额	8,000,016,404.20
基金合同生效日起至报告期期末基金 总申购份额	—

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	8,000,016,404.20

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况

（1）本基金管理人于 2020 年 1 月 23 日发布公告，自 2020 年 1 月 22 日起：范宇先生担任公司董事长；汤海涛先生因组织调动，不再担任公司董事长职务；王健先生、金芳女士、宋卫华先生均不再担任公司副总经理职务。

（2）本基金管理人于 2020 年 3 月 7 日发布公告，自 2020 年 3 月 6 日起公司法定代表人变更为范宇先生。

（3）本基金管理人于 2020 年 4 月 24 日发布公告，自 2020 年 4 月 22 日起尤象都先生担任公司总经理。

（4）本基金管理人于 2020 年 4 月 30 日发布公告，自 2020 年 4 月 29 日起季勇先生担任公司副总经理。

（5）本基金管理人于 2020 年 6 月 24 日发布公告，自 2020 年 6 月 22 日起史彦刚先生担任公司副总经理。

（6）本基金管理人于 2020 年 7 月 31 日发布公告，自 2020 年 7 月 29 日起吴东先生不再担任公司副总经理、首席信息官，尤象都先生担任公司首席信息官。

（7）本基金管理人于 2020 年 8 月 1 日发布公告，自 2020 年 7 月 31 日起岳冲先生不再担任公司督察长，尤象都先生代为履行督察长职责。

（8）本基金管理人于 2020 年 10 月 24 日发布公告，自 2020 年 10 月 23 日起王炯女士担任公司督察长，尤象都先生不再代任督察长。

（9）本基金管理人于 2020 年 12 月 26 日发布公告，自 2020 年 12 月 24 日起王炯女士担任公司首席信息官，尤象都先生不再兼任首席信息官。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2020 年 08 月 07 日）起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。本报告期内应支付的审计费用为人民币壹拾贰万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

上述交易单元均为在本报告期内新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	15,458,932.80	100.00%	49,251,500,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 08 月 08 日
2	太平恒泽 63 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	2020 年 08 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20200807-20201231	2,499,999.00	-	-	2,499,999.00	31.2499
机构	2	20200807-20201231	1,999,999.00	-	-	1,999,999.00	24.9999
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险,甚至引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2021 年 3 月 25 日