

太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券  
投资基金  
2022 年中期报告

2022 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 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 .....	7
2.4 信息披露方式 .....	8
2.5 其他相关资料 .....	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	8
3.2 基金净值表现 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	20
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	44
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 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
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 .....	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.11 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	太平丰泰一年定开债券发起式
基金主代码	012140
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 24 日
基金管理人	太平基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,909,998,000.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求资产长期稳健增值的基础上，力争为份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合，形成对大类资产的预测和判断，在基金合同约定的范围内确定债券类资产、权益类资产、现金类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例，以规避市场风险，提高基金收益率。</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、资产支持证券投资策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。</p> <p>1、久期策略</p> <p>本基金将基于对宏观经济政策的分析，积极的预测未来利率变化趋势，并根据预测确定相应的久期目标，调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时，本基金将适当降低组合久期；而预期市场利率将下降时，则适当提高组合久期。在确定债券组合久期的过程中，本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。</p> <p>2、收益率曲线策略</p> <p>在组合的久期配置确定以后，本基金将通过研究收益率曲线的形状变化，分析并预测收益率曲线可能发生的形状变化，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。</p> <p>3、类属配置策略</p>

	<p>本基金对不同类型债券的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>4、利率品种策略</p> <p>本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。</p> <p>5、信用债策略</p> <p>本基金所指信用债包括：金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债和中期票据等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用担保的固定收益类金融工具。</p> <p>本基金不得投资于信用评级低于 AA+ 的信用债，其中投资于 AA+ 评级信用债的比例不超过信用债资产总值的 50%，投资于 AAA 评级信用债的比例占信用债资产总值的 50%-100%。</p> <p>金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、资产支持证券、次级债和中期票据等信用债的信用评级依照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级；短期融资券和超短期融资券等信用债的信用评级依照基金管理人选定评级机构出具的主体信用评级。</p> <p>本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值 and 风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，谨慎进行对国债期货的投资。</p> <p>8、杠杆投资策略</p> <p>杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。</p> <p>9、可转换债券投资策略</p> <p>本基金持有全部可转债总市值不超过基金资产净值的 20%。基金管</p>
--	---

	<p>理人着重对可转换债券对应的基础股票的分析与研究，同时兼顾其债券价值和转换期权价值，对那些有着较强的盈利能力或成长潜力的上市公司的可转换债券进行重点投资。本基金管理人将对可转换债券对应的基础股票的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、成长性、核心竞争力等，并参考同类公司的估值水平，研判发行公司的投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。</p> <p>10、股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资策略以精选个股为主，发挥基金管理人专业研究团队的研究能力，从定量和定性两个方面考察国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地上市公司的增值潜力。定量方面综合考虑盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，包括净资产与市值比率(B/P)、每股盈利/每股市价（E/P）、年现金流/市值（cashflow-to-price）和销售收入/市值（S/P）等价值指标以及净资产收益率（ROE）、每股收益增长率和主营业务收入增长率等成长指标。定性方面考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势等多种因素，精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。</p> <p>本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>在开放期，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化，基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金可能投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵霖	姜敏
	联系电话	021-38556613	4006800000
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		021-61560999/400-028-8699	95558
传真		021-38556677	010-85230024
注册地址		上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
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	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

邮政编码	200120	100020
法定代表人	焦艳军	朱鹤新

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	31,010,932.29
本期利润	6,136,683.90
加权平均基金份额本期利润	0.0021
本期加权平均净值利润率	0.21%
本期基金份额净值增长率	0.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	46,688,348.05
期末可供分配基金份额利润	0.0160
期末基金资产净值	2,970,314,144.39
期末基金份额净值	1.0207
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.58%

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

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

3、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

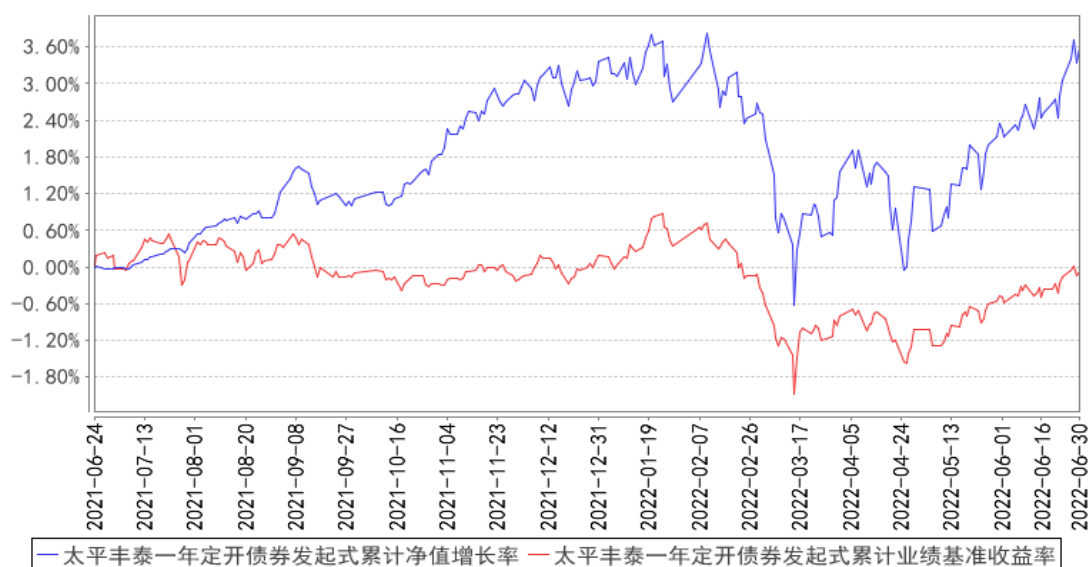
阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----



	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	1.21%	0.24%	0.41%	0.11%	0.80%	0.13%
过去三个月	2.41%	0.32%	0.89%	0.13%	1.52%	0.19%
过去六个月	0.21%	0.33%	-0.26%	0.17%	0.47%	0.16%
过去一年	3.62%	0.24%	-0.24%	0.14%	3.86%	0.10%
自基金合同生效起至今	3.58%	0.24%	-0.07%	0.14%	3.65%	0.10%

### 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

太平丰泰一年定开债券发起式累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 6 月 24 日，本基金建仓期为自基金合同生效起六个月，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 28 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、太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金、太平睿享混合型证券投资基金、太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平恒兴纯债债券型证券投资基金、太平睿庆混合型证券投资基金、太平中证 1000 指数增强型证券投资基金、太平安元债券型证券投资基金、太平嘉和三个月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	2021 年 6 月 24 日	-	9 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

	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、太平恒泽 63 个月定期开放债券型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、太平睿享混合型证券投资基金基金经理				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。2021 年 9 月 17 日起担任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。
苏大 明	本基金的基金经理助理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理助理、太平丰和一年定期开放债券型	2021 年 9 月 24 日	-	10 年	格罗宁根大学金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2012 年起先后在大公国际资信评估有限公司、长江养老保险股份有限公司从事信用评估研究相关工作。2016 年 4 月加入本公司，从事投资研究及管理工作。2021 年 9 月 24 日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理助理。2021 年 9 月 24 日起担任太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理。2021 年 9 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

	发起式证券投资基金基金经理助理				金经理助理。
--	-----------------	--	--	--	--------

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

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

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

##### 4.3.2 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

2022 年上半年经济经历了持续的波动，第一季度经济开局良好，第二季度经济经受了新一轮疫情的影响，同时国外包括俄乌冲突、国外通胀大幅飙升、美联储加息缩表等等超预期的因素对国内经济和资本市场都造成一定的扰动。本报告期内，本基金在二季度加仓少量股票仓位，调仓

部分至港股通板块，转债部分在 1 月份减仓，4-5 月加回部分转债仓位。纯债方面主要以中短久期高等级信用债套息为主。整体组合仍然通过股债平衡的思路进行仓位管理，利用动态的仓位调整力求控制回撤。

#### 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 0.21%，同期业绩比较基准为-0.26%。

#### 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，疫情防控逐渐取得成效，各地复工复产有序推进，同时此前受到影响的线下消费活动将明显修复。从高频数据来看，生产端的修复明显领先于需求端，随着供应链、物流以及防疫政策的改善，预计三季度需求端也将环比改善。展望权益市场，后续我们将进一步关注制造业中汽车及零部件、机械设备、电子和通信制造行业，以及疫情后消费复苏改善的食品饮料、交通运输、地产后周期的家电家具等行业，还有政策一直大力支持且景气度较高的光伏风电、国防军工板块。债券市场资金面持续保持宽松状态，收益率曲线基本保持平稳。后续需要关注各项政策的宽信用效果如何，从而决定经济增速恢复的强度来确定债券收益率的空间。

#### 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。公司估值与产品委员会下设估值分委会，常任委员由稽核风控部、投资部门、研究部、基金运营部等部门负责人担任。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 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《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的约

定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，各基金份额类别每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 20%。

本基金管理人在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。

#### 4.8 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，太平基金管理有限公司在太平丰泰一年定期开放债券型发起式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，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，太平基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2022 年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，未发现有关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：太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	6.4.7.1	36,968,668.73	7,842,272.34
结算备付金		16,947,937.75	25,948,780.99
存出保证金		997,283.87	1,105,055.20
交易性金融资产	6.4.7.2	3,916,428,587.51	5,267,138,003.92
其中：股票投资		481,846,454.61	427,195,034.43
基金投资		-	-
债券投资		3,196,504,384.71	4,562,070,969.49
资产支持证券投资		238,077,748.19	277,872,000.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	15,000,000.00	8,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		12,272,422.83	185,277,444.78
应收股利		3,740,401.61	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	71,826,177.34
资产总计		4,002,355,302.30	5,567,137,734.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021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		1,016,688,342.84	2,414,133,351.88
应付清算款		13,641,796.33	187,056,018.77
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		846,466.75	884,895.52
应付托管费		193,478.11	202,261.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		91,776.61	77,903.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	579,297.27	605,842.38
负债合计		1,032,041,157.91	2,602,960,274.08
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.10	2,909,998,000.00	2,909,998,000.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	60,316,144.39	54,179,460.49
净资产合计		2,970,314,144.39	2,964,177,460.49
负债和净资产总计		4,002,355,302.30	5,567,137,734.57

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0207 元，基金份额总额 2,909,998,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 24 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		31,394,778.48	-932,936.62
1. 利息收入		640,619.88	1,379,125.49
其中：存款利息收入	6.4.7.13	333,465.38	58,374.32
债券利息收入		-	86,025.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		307,154.50	1,234,726.04
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		55,628,406.99	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-48,962,766.95	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	91,040,546.01	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	4,621,136.25	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	8,929,491.68	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-24,874,248.39	-2,312,062.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-



5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		25,258,094.58	220,796.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,080,997.15	167,416.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,161,370.83	38,266.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		18,850,443.18	-
其中：卖出回购金融资产支出		18,850,443.18	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		55,591.01	193.43
8. 其他费用	6.4.7.23	109,692.41	14,919.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,136,683.90	-1,153,732.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		6,136,683.90	-1,153,732.63
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		6,136,683.90	-1,153,732.63

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,909,998,000.00	-	54,179,460.49	2,964,177,460.49
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基	2,909,998,000.00	-	54,179,460.49	2,964,177,460.49

金净值)				
三、本期 增减变动额(减少以“-” 号填列)	-	-	6,136,683.90	6,136,683.90
(一)、 综合收益总额	-	-	6,136,683.90	6,136,683.90
(二)、 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	-	-	-	-
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净	2,909,998,000.00	-	60,316,144.39	2,970,314,144.39

资产(基金净值)				
项目	上年度可比期间			
	2021年6月24日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,909,998,000.00	-	-	2,909,998,000.00
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,909,998,000.00	-	-	2,909,998,000.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-1,153,732.63	-1,153,732.63
(一)、综合收益总额	-	-	-1,153,732.63	-1,153,732.63
(二)、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				
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	2,909,998,000.00	-	-1,153,732.63	2,908,844,267.37

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>范宇</u>	<u>史彦刚</u>	<u>王瑞瑾</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

太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金(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[2021]942号《关于准予太平丰泰一年定期开放债券型发起式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《太平丰泰一年定期开放债券型发起式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2,909,998,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)予以验证。经向中国证监会备案,《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2021年6月24日正

式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,909,998,000.00 份,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,000.00 基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、资产支持证券、银行存款、国债期货、同业存单、债券回购等金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:债券的投资比例不低于基金资产的 80%,但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内,基金投资不受上述比例限制;港股通标的股票的投资比例不超过基金股票资产的 50%;开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,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:中债综合指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《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>》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1)以摊余成本计量的金融资产；(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日(即 2022 年 1 月 1 日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、【结算备付金、】【存出保证金、】【买入返售金融资产、】【应收证券清算款、】应收利息、【应收股利、】【应收申购款】【和其他资产】，对应的账面价值分别为人民币 7,842,272.34 元、【25,948,780.99 元、】【1,105,055.20 元、】【8,000,000.00 元、】【185,277,444.78 元、】71,826,177.34 元、【0 元、】【0 元】和【0 元】。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、【结算备付金、】【存出保证金、】【买入返售金融资产、】【应收证券清算款、】【应收股利、】【应收申购款】【和其他资产】，对应的账面价值分别为人民币 7,845,273.14 元、【25,961,998.17 元、】【1,105,368.83 元、】【8,002,265.56 元、】【185,277,444.78 元、】【0 元、】【0 元】和【0 元】。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产【和衍生金融资产】，对应的账面价值【分别】为人民币 5,267,138,003.92 元【和 0 元】。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产【和衍生金融资产】，对应的账面价值【分别】为人民币 5,338,945,384.09 元【和 0 元】。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为【卖出回购金融资产款、】【应付证券清算款、】【应付赎回款、】应付管理人报酬、应付托管费、【应付销售服务费、】【应付交易费用、】【应交税费、】应付利息【和其他负债】，对应的账面价值分别为人民币【2,414,133,351.88 元、】【187,056,018.77 元、】【0 元、】884,895.52 元、202,261.85 元、【0 元、】【430,398.13 元、】【77,903.68 元、】13,444.25 元【和 162,000.00 元】。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为【卖出回购金融资产款、】【应付证券清算款、】【应付赎回款、】应付管理人报酬、应付托管费、【应付销售服务费、】【应交税费、】【和其他负债】，对应的账面价值分别为人民币【2,414,146,796.13 元、】【187,056,018.77 元、】【0 元、】884,895.52 元、202,261.85 元、【0 元、】【77,903.68 元、】【和 592,398.13 元】。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。



(b)自 2016 年 5 月 1 日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,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;转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日(含)以后,管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税;对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税;同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)取得的股息、红利所得,由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	36,968,668.73
等于：本金	36,964,594.62
加：应计利息	4,074.11
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	36,968,668.73

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	491,338,503.87	-	481,846,454.61	-9,492,049.26	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,311,230,956.61	21,572,760.94	2,355,821,829.17	23,018,111.62
	银行间市场	829,388,152.60	11,470,555.54	840,682,555.54	-176,152.60
	合计	3,140,619,109.21	33,043,316.48	3,196,504,384.71	22,841,959.02

资产支持证券	234,153,713.42	3,646,148.19	238,077,748.19	277,886.58
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,866,111,326.50	36,689,464.67	3,916,428,587.51	13,627,796.34

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	15,000,000.00	-

##### 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买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金于本报告期末无按预期信用损失一般模型计提的减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期内无其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	378,962.23
其中：交易所市场	361,902.70

银行间市场	17,059.53
应付利息	-
预提审计费	20,827.67
预提信息披露费	179,507.37
合计	579,297.27

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,909,998,000.00	2,909,998,000.00
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	2,909,998,000.00	2,909,998,000.00

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	15,677,415.76	38,502,044.73	54,179,460.49
本期利润	31,010,932.29	-24,874,248.39	6,136,683.90
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	46,688,348.05	13,627,796.34	60,316,144.39

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	活期存款利息收入	42,769.73
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	284,331.17	
其他	6,364.48	

合计	333,465.38
----	------------

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-48,962,766.95
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-48,962,766.95

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	453,103,209.78
减：卖出股票成本总额	500,490,374.67
减：交易费用	1,575,602.06
买卖股票差价收入	-48,962,766.95

##### 6.4.7.14.3 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证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	62,022,468.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	29,018,077.78
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	91,040,546.01

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,264,694,637.79

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,199,265,192.87
减：应计利息总额	36,376,432.54
减：交易费用	34,934.60
买卖债券差价收入	29,018,077.78

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	4,621,156.30
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-20.05
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,621,136.25

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	129,507,721.99
减：卖出资产支持证券成本总额	127,160,400.00
减：应计利息总额	2,347,321.99
减：交易费用	20.05
资产支持证券投资收益	-20.05

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,929,491.68
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,929,491.68

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-24,874,248.39
股票投资	-12,526,754.02
债券投资	-12,058,380.95
资产支持证券投资	-289,113.42
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产生的预估增值税	-
合计	-24,874,248.39

#### 6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	20,827.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	10,757.37
账户维护费	18,600.00
合计	109,692.41

## 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 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

于 2022 年 1 月，经本基金的基金管理人太平基金股东会决议通过，并根据中国证监会批复核准(证监许可[2021]4051 号)，太平人寿保险有限公司认缴太平基金新增注册资本，增资事项完成后，太平资产管理有限公司、太平人寿保险有限公司及安石投资管理有限公司对太平基金的持股比例分别变更为 56.31%、38.46%、5.23%。上述事项的工商变更登记已于 2022 年 1 月 27 日办理完毕。

### 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
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人
太平人寿保险有限公司(“太平人寿”)	基金管理人的股东

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没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

#### 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没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

#### 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没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

#### 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没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 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没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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,080,997.15	167,416.69
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人太平基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.35%/当年天数

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,161,370.83	38,266.67

注：支付基金托管行中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.08%/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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 6 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 6 月 24 日）持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3436%	0.3436%

注：本基金管理人按照本基金基金合同、招募说明书的约定费率进行认购、申购和赎回，不享有比其他投资人更优惠的费率。

##### 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		上年度末	
	2022 年 6 月 30 日		2021 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 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
太平人寿	2,899,998,000.00	99.6564	-	-

#### 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		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 6 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 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
中信银行	36,968,668.73	42,769.73	126,193,803.06	58,374.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，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购入过由关联方承销的证券。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022 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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

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 2022 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人民币 115,023,417.29 元，是以如下债券作为质押：

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
220304	22 进出 04	2022 年 7 月 5 日	100.28	500,000	50,140,205.48
2203679	22 进出 679	2022 年 7 月 5 日	99.64	500,000	49,819,788.04
220404	22 农发 04	2022 年 7 月 5 日	99.92	224,000	22,382,816.44
合计				1,224,000	122,342,809.96

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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人民币 901,664,925.55 元，于 2022 年 7 月 5 日，7 月 6 日，7 月 12 日，7 月 13 日，7 月 18 日，7 月 20 日，7 月 26 日，7 月 29 日，8 月 8 日，8 月 9 日，8 月 11 日，8 月 12 日，8 月 15 日，8 月 16 日，8 月 23 日，8 月 26 日，8 月 31 日，9 月 6 日，10 月 25 日，11 月 8 日，11

月 10 日，11 月 15 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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中信银行，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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	30,847,389.04	30,096,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	190,335,686.68	10,003,000.00
合计	221,183,075.72	40,099,000.00

注：未评级债券为短期融资券等无评级债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	98,906,456.60	196,770,000.00
合计	98,906,456.60	196,770,000.00

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	2,529,993,528.66	3,811,936,396.16
AAA 以下	212,747,411.16	338,555,413.33
未评级	133,673,912.57	174,710,160.00
合计	2,876,414,852.39	4,325,201,969.49

注：未评级债券为国债、政策性金融债等免评级债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	238,077,748.19	277,872,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	238,077,748.19	277,872,000.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1,016,688,342.84 元将在六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同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 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 6.4.13.3.2 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时间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发行的证券不得超过该证券的 10%，于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构

成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 2022 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 2022 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。

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。

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	36,968,668.73	-	-	-	36,968,668.73
结算备付金	16,947,937.75	-	-	-	16,947,937.75
存出保证金	997,283.87	-	-	-	997,283.87
交易性金融资产	1,371,992,531.70	1,602,979,005.37	459,610,595.83	481,846,454.61	3,916,428,587.51
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收股利	-	-	-	3,740,401.61	3,740,401.61
应收清算款	-	-	-	12,272,422.83	12,272,422.83
<b>资产总计</b>	<b>1,441,906,422.05</b>	<b>1,602,979,005.37</b>	<b>459,610,595.83</b>	<b>497,859,279.05</b>	<b>4,002,355,302.30</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	846,466.75	846,466.75
应付托管费	-	-	-	193,478.11	193,478.11
应付清算款	-	-	-	13,641,796.33	13,641,796.33
卖出回购金融资产款	1,016,688,342.84	-	-	-	1,016,688,342.84
应交税费	-	-	-	91,776.61	91,776.61
其他负债	-	-	-	579,297.27	579,297.27
<b>负债总计</b>	<b>1,016,688,342.84</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>15,352,815.07</b>	<b>1,032,041,157.91</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>425,218,079.21</b>	<b>1,602,979,005.37</b>	<b>459,610,595.83</b>	<b>482,506,463.98</b>	<b>2,970,314,144.39</b>
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	7,842,272.34	-	-	-	7,842,272.34
结算备付金	25,948,780.99	-	-	-	25,948,780.99
存出保证金	1,105,055.20	-	-	-	1,105,055.20
交易性金融资产	1,537,638,631.49	2,853,154,338.00	449,150,000.00	427,195,034.43	5,267,138,003.92
买入返售金融资产	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	185,277,444.78	185,277,444.78
其他资产	-	-	-	71,826,177.34	71,826,177.34
<b>资产总计</b>	<b>1,580,534,740.02</b>	<b>2,853,154,338.00</b>	<b>449,150,000.00</b>	<b>684,298,656.55</b>	<b>5,567,137,734.57</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	884,895.52	884,895.52
应付托管费	-	-	-	202,261.85	202,261.85
应付证券清算款	-	-	-	187,056,018.77	187,056,018.77
卖出回购金融资产款	2,414,133,351.88	-	-	-	2,414,133,351.88
应交税费	-	-	-	77,903.68	77,903.68
其他负债	-	-	-	605,842.38	605,842.38
<b>负债总计</b>	<b>2,414,133,351.88</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>188,826,922.20</b>	<b>2,602,960,274.08</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>-833,598,611.86</b>	<b>2,853,154,338.00</b>	<b>449,150,000.00</b>	<b>495,471,734.35</b>	<b>2,964,177,460.49</b>



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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	24,025,433.03	29,618,852.48
	市场利率上升 25 个基点	-23,628,256.96	-29,254,115.20

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	238,530,772.42	-	238,530,772.42
应收股利	-	3,740,401.61	-	3,740,401.61
资产合计	-	242,271,174.03	-	242,271,174.03
以外币计价的负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	242,271,174.03	-	242,271,174.03
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	80,610,920.44	-	80,610,920.44
资产合计	-	80,610,920.44	-	80,610,920.44
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	80,610,920.44	-	80,610,920.44

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	1. 所有外币相对 人民币升值 5%	11,926,538.62	4,030,546.02
	2. 所有外币相对 人民币贬值 5%	-11,926,538.62	-4,030,546.02

#### 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。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 16.22%（2021 年 12 月 31 日：14.41%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	946,491,711.62	1,010,475,165.92
第二层次	2,969,936,875.89	4,256,662,838.00
第三层次	-	-
合计	3,916,428,587.51	5,267,138,003.92

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具 (2021 年 12 月 31 日：无)。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	481,846,454.61	12.04
	其中：股票	481,846,454.61	12.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,434,582,132.90	85.81
	其中：债券	3,196,504,384.71	79.87
	资产支持证券	238,077,748.19	5.95
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	15,000,000.00	0.37
	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	53,916,606.48	1.35
8	其他各项资产	17,010,108.31	0.43
9	合计	4,002,355,302.30	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,354,168.00	0.18
C	制造业	130,459,482.80	4.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,386,917.00	0.45
E	建筑业	29,482,316.99	0.99
F	批发和零售业	1,295,718.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	9,981,816.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	737,200.00	0.02
J	金融业	46,414,218.40	1.56
K	房地产业	1,900,567.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,303,278.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	243,315,682.19	8.19

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	4,787,216.79	0.16
非日常生活消费品	34,505,283.08	1.16
日常消费品	20,856,288.21	0.70
能源	9,018,987.68	0.30
金融	32,351,314.32	1.09
医疗保健	11,426,381.74	0.38
工业	36,688,766.17	1.24
信息技术	17,709,539.63	0.60
通信服务	22,149,934.11	0.75
公用事业	11,187,356.13	0.38
房地产	37,849,704.56	1.27
合计	238,530,772.42	8.03

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600580	卧龙电驱	1,647,100	23,751,182.00	0.80
2	601668	中国建筑	2,674,500	14,228,340.00	0.48
3	002643	万润股份	650,300	13,565,258.00	0.46
4	002966	苏州银行	2,159,050	13,170,205.00	0.44
5	600496	精工钢构	2,470,800	11,415,096.00	0.38
6	601012	隆基绿能	154,980	10,326,317.40	0.35
7	300059	东方财富	401,620	10,201,148.00	0.34
8	600036	招商银行	228,100	9,625,820.00	0.32
9	600887	伊利股份	228,200	8,888,390.00	0.30
10	601006	大秦铁路	1,340,700	8,835,213.00	0.30
11	600900	长江电力	381,100	8,811,032.00	0.30
12	00291	华润啤酒	172,000	8,604,921.78	0.29
13	00941	中国移动	200,000	8,380,862.00	0.28
14	00700	腾讯控股	27,500	8,334,681.74	0.28
15	02208	金风科技	656,800	8,245,591.47	0.28
16	02333	长城汽车	573,000	7,908,985.26	0.27
17	01186	中国铁建	1,620,000	6,802,352.30	0.23
18	02313	申洲国际	81,200	6,600,407.73	0.22
19	00168	青岛啤酒股份	94,000	6,559,649.38	0.22
20	00285	比亚迪电子	304,000	6,434,449.56	0.22
21	06098	碧桂园服务	214,000	6,396,222.57	0.22
22	000090	天健集团	893,400	6,155,526.00	0.21
23	03900	绿城中国	437,500	6,083,607.86	0.20
24	00175	吉利汽车	396,000	6,041,609.48	0.20

25	00836	华润电力	436,000	6,040,378.01	0.20
26	01995	旭辉永升服务	702,000	6,003,433.80	0.20
27	00257	光大环境	1,498,000	5,931,375.49	0.20
28	02020	安踏体育	71,600	5,902,726.63	0.20
29	01398	工商银行	1,452,000	5,786,489.20	0.19
30	02382	舜宇光学科技	52,900	5,786,138.57	0.19
31	600741	华域汽车	250,000	5,750,000.00	0.19
32	00688	中国海外发展	270,500	5,736,956.60	0.19
33	01093	石药集团	858,000	5,715,936.03	0.19
34	02269	药明生物	93,000	5,710,445.71	0.19
35	02319	蒙牛乳业	170,000	5,691,717.05	0.19
36	01109	华润置地	180,000	5,633,991.72	0.19
37	03690	美团-W	33,600	5,580,217.37	0.19
38	00388	香港交易所	16,800	5,545,736.11	0.19
39	01658	邮储银行	1,039,000	5,535,619.21	0.19
40	01347	华虹半导体	226,000	5,488,951.50	0.18
41	02601	中国太保	332,600	5,455,486.20	0.18
42	00728	中国电信	2,380,000	5,434,390.37	0.18
43	00960	龙湖集团	171,500	5,433,941.40	0.18
44	600939	重庆建工	1,200,903	5,199,909.99	0.18
45	01288	农业银行	2,044,000	5,174,104.75	0.17
46	00916	龙源电力	397,000	5,146,978.12	0.17
47	00939	建设银行	1,077,000	4,853,878.85	0.16
48	03323	中国建材	668,000	4,787,216.79	0.16
49	00883	中国海洋石油	538,000	4,766,555.40	0.16
50	01800	中国交通建设	1,362,000	4,705,665.87	0.16
51	03996	中国能源建设	5,044,000	4,701,800.41	0.16
52	000778	新兴铸管	900,500	4,340,410.00	0.15
53	300284	苏交科	617,400	4,303,278.00	0.14
54	01088	中国神华	221,000	4,252,432.28	0.14
55	600926	杭州银行	276,280	4,138,674.40	0.14
56	00390	中国中铁	986,000	4,089,604.10	0.14
57	600019	宝钢股份	670,400	4,035,808.00	0.14
58	601009	南京银行	358,400	3,734,528.00	0.13
59	688408	中信博	40,135	3,711,684.80	0.12
60	600025	华能水电	482,800	3,374,772.00	0.11
61	603916	苏博特	128,900	3,285,661.00	0.11
62	601658	邮储银行	581,300	3,133,207.00	0.11
63	002078	太阳纸业	250,000	3,077,500.00	0.10
64	002283	天润工业	433,100	2,958,073.00	0.10
65	600031	三一重工	150,000	2,859,000.00	0.10
66	600585	海螺水泥	73,900	2,607,192.00	0.09

67	01209	华润万象生活	77,000	2,561,550.61	0.09
68	02015	理想汽车-W	18,900	2,471,336.61	0.08
69	600933	爱柯迪	150,000	2,457,000.00	0.08
70	603596	伯特利	30,200	2,421,436.00	0.08
71	002032	苏泊尔	40,000	2,253,600.00	0.08
72	300408	三环集团	73,500	2,212,350.00	0.07
73	01919	中远海控	200,000	1,874,576.48	0.06
74	600399	抚顺特钢	100,000	1,790,000.00	0.06
75	300850	新强联	16,800	1,495,704.00	0.05
76	601155	新城控股	50,000	1,271,500.00	0.04
77	601390	中国中铁	200,000	1,228,000.00	0.04
78	601186	中国铁建	152,300	1,203,170.00	0.04
79	600123	兰花科创	59,800	983,710.00	0.03
80	002822	中装建设	175,700	918,911.00	0.03
81	300861	美畅股份	9,700	899,093.00	0.03
82	600348	华阳股份	49,800	769,908.00	0.03
83	603444	吉比特	1,900	737,200.00	0.02
84	600586	金晶科技	94,500	713,475.00	0.02
85	600873	梅花生物	62,700	707,256.00	0.02
86	601369	陕鼓动力	73,500	705,600.00	0.02
87	603355	莱克电气	27,500	693,825.00	0.02
88	300433	蓝思科技	61,400	679,698.00	0.02
89	601088	中国神华	20,400	679,320.00	0.02
90	002048	宁波华翔	42,100	674,442.00	0.02
91	000100	TCL 科技	139,900	670,121.00	0.02
92	000157	中联重科	107,500	662,200.00	0.02
93	600729	重庆百货	30,400	655,728.00	0.02
94	600409	三友化工	79,200	648,648.00	0.02
95	002601	龙佰集团	32,300	647,615.00	0.02
96	600282	南钢股份	204,100	642,915.00	0.02
97	002556	辉隆股份	54,700	639,990.00	0.02
98	002539	云图控股	39,900	638,001.00	0.02
99	600395	盘江股份	72,600	636,702.00	0.02
100	000651	格力电器	18,800	633,936.00	0.02
101	601678	滨化股份	105,700	633,143.00	0.02
102	000789	万年青	58,400	633,056.00	0.02
103	600808	马钢股份	166,300	630,277.00	0.02
104	600325	华发股份	83,100	629,067.00	0.02
105	601577	长沙银行	79,100	627,263.00	0.02
106	601139	深圳燃气	90,200	625,988.00	0.02
107	000825	太钢不锈	114,700	625,115.00	0.02
108	002563	森马服饰	105,400	623,968.00	0.02

109	000703	恒逸石化	58,900	619,039.00	0.02
110	600985	淮北矿业	42,200	614,432.00	0.02
111	000933	神火股份	46,900	613,452.00	0.02
112	601229	上海银行	92,000	602,600.00	0.02
113	002532	天山铝业	92,200	602,066.00	0.02
114	601699	潞安环能	41,000	599,420.00	0.02
115	000800	一汽解放	63,400	592,156.00	0.02
116	600928	西安银行	161,100	591,237.00	0.02
117	601857	中国石油	111,300	589,890.00	0.02
118	600919	江苏银行	82,800	589,536.00	0.02
119	601298	青岛港	107,400	587,478.00	0.02
120	601158	重庆水务	107,500	575,125.00	0.02
121	688298	东方生物	4,944	564,357.60	0.02
122	600350	山东高速	106,500	559,125.00	0.02
123	600398	海澜之家	116,800	554,800.00	0.02
124	600606	绿地控股	138,500	548,460.00	0.02
125	002110	三钢闽光	87,400	532,266.00	0.02
126	601225	陕西煤业	22,700	480,786.00	0.02
127	002487	大金重工	10,000	417,300.00	0.01
128	00177	江苏宁沪高速公路	50,000	337,800.05	0.01

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002966	苏州银行	20,175,230.00	0.68
2	600919	江苏银行	16,269,498.48	0.55
3	601658	邮储银行	14,516,278.00	0.49
4	000069	华侨城 A	14,505,467.10	0.49
5	601009	南京银行	12,974,251.00	0.44
6	601668	中国建筑	12,887,440.00	0.43
7	600926	杭州银行	10,913,900.20	0.37
8	600939	重庆建工	10,684,318.15	0.36
9	001979	招商蛇口	9,992,867.92	0.34
10	000656	金科股份	8,996,228.00	0.30
11	601128	常熟银行	8,560,777.00	0.29
12	00941	中国移动	8,369,872.88	0.28
13	00688	中国海外发展	8,327,259.16	0.28
14	01186	中国铁建	7,177,427.03	0.24
15	600031	三一重工	7,128,974.18	0.24
16	01995	旭辉永升服务	7,083,205.66	0.24



17	03690	美团-W	6,873,671.63	0.23
18	06098	碧桂园服务	6,621,630.08	0.22
19	601186	中国铁建	6,611,339.00	0.22
20	02382	舜宇光学科技	6,602,703.28	0.22

注：买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600919	江苏银行	15,998,520.88	0.54
2	000069	华侨城 A	11,909,379.00	0.40
3	601658	邮储银行	10,613,619.00	0.36
4	601009	南京银行	10,263,720.00	0.35
5	001979	招商蛇口	9,887,384.60	0.33
6	002202	金风科技	8,898,607.65	0.30
7	601128	常熟银行	8,755,064.00	0.30
8	000725	京东方 A	8,194,500.00	0.28
9	300073	当升科技	7,928,232.00	0.27
10	603501	韦尔股份	7,885,020.00	0.27
11	600893	航发动力	7,490,884.00	0.25
12	000333	美的集团	7,429,054.00	0.25
13	601012	隆基绿能	7,400,159.00	0.25
14	300498	温氏股份	7,354,588.00	0.25
15	000656	金科股份	7,228,141.00	0.24
16	600502	安徽建工	7,117,649.40	0.24
17	600926	杭州银行	6,903,602.00	0.23
18	002966	苏州银行	6,235,304.00	0.21
19	000858	五粮液	5,912,411.12	0.20
20	600031	三一重工	5,904,143.00	0.20

注：卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	567,668,548.87
卖出股票收入（成交）总额	453,103,209.78

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	31,330,114.75	1.05

2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,067,374,346.42	69.60
	其中：政策性金融债	252,265,435.18	8.49
4	企业债券	441,202,651.16	14.85
5	企业短期融资券	71,261,438.36	2.40
6	中期票据	10,428,200.00	0.35
7	可转债（可交换债）	476,001,177.42	16.03
8	同业存单	98,906,456.60	3.33
9	其他	-	-
10	合计	3,196,504,384.71	107.62

### 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	149499	21 广发 03	1,500,000	152,387,095.89	5.13
2	149482	21 长城 02	1,300,000	131,943,389.59	4.44
3	2028033	20 建设银行二级	1,000,000	106,639,589.04	3.59
4	122374	14 招商债	1,000,000	106,440,832.88	3.58
5	175684	21 国君 C1	1,000,000	103,118,586.30	3.47

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	136235	21 弘基 3A	900,000	92,947,872.33	3.13
2	136825	起航 05 优	300,000	30,476,630.14	1.03
3	183005	恒信 45A2	300,000	30,176,477.26	1.02
4	193724	GC 蔚来 A	500,000	26,849,024.93	0.90
5	183874	GC 蔚能 A1	200,000	20,042,359.45	0.67
6	183026	安驰 2A1	900,000	13,644,887.00	0.46
7	183294	22 平 3A1	300,000	13,505,234.92	0.45
8	183290	22 新 1A1	340,000	10,435,262.16	0.35

### 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

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 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，中国工商银行股份有限公司、中国建设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。

#### 7.11.2 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	997,283.87
2	应收清算款	12,272,422.83
3	应收股利	3,740,401.61
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,010,108.31

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113044	大秦转债	98,152,273.97	3.30
2	127032	苏行转债	36,372,264.66	1.22
3	113052	兴业转债	29,714,678.55	1.00
4	110080	东湖转债	20,265,574.06	0.68
5	128132	交建转债	18,823,356.59	0.63
6	127012	招路转债	17,547,223.79	0.59
7	128129	青农转债	15,676,345.87	0.53
8	113050	南银转债	15,012,844.43	0.51
9	113516	苏农转债	11,976,770.51	0.40
10	110081	闻泰转债	11,432,714.67	0.38
11	127016	鲁泰转债	9,848,543.69	0.33
12	110064	建工转债	9,175,772.05	0.31
13	113037	紫银转债	7,827,438.51	0.26

14	110067	华安转债	6,825,264.06	0.23
15	110079	杭银转债	5,660,259.33	0.19
16	127029	中钢转债	5,658,989.31	0.19
17	113046	金田转债	5,471,326.80	0.18
18	123121	帝尔转债	5,445,673.75	0.18
19	110047	山鹰转债	5,282,230.60	0.18
20	110063	鹰 19 转债	5,146,710.69	0.17
21	113043	财通转债	4,505,157.09	0.15
22	123107	温氏转债	4,243,390.20	0.14
23	113623	凤 21 转债	4,081,810.71	0.14
24	113033	利群转债	3,880,368.37	0.13
25	128138	侨银转债	3,270,193.51	0.11
26	113582	火炬转债	2,953,338.40	0.10
27	128037	岩土转债	2,765,731.23	0.09
28	127033	中装转 2	2,758,366.38	0.09
29	128135	洽洽转债	2,598,481.76	0.09
30	127034	绿茵转债	2,518,283.35	0.08
31	110057	现代转债	2,308,983.30	0.08
32	127049	希望转 2	2,258,579.69	0.08
33	128083	新北转债	2,105,135.65	0.07
34	128121	宏川转债	1,897,591.24	0.06
35	127025	冀东转债	1,896,473.82	0.06
36	113505	杭电转债	1,891,865.42	0.06
37	127045	牧原转债	1,713,117.82	0.06
38	123035	利德转债	1,690,044.52	0.06
39	113563	柳药转债	1,454,385.10	0.05
40	113030	东风转债	1,269,242.47	0.04
41	128087	孚日转债	1,087,647.45	0.04
42	113609	永安转债	1,065,792.24	0.04
43	127039	北港转债	1,042,505.71	0.04
44	113591	胜达转债	1,029,867.30	0.03
45	128097	奥佳转债	1,027,694.86	0.03
46	127005	长证转债	1,025,437.95	0.03
47	128044	岭南转债	1,022,726.12	0.03
48	127020	中金转债	1,019,147.81	0.03
49	127042	嘉美转债	1,016,887.48	0.03
50	128119	龙大转债	1,015,633.75	0.03
51	123120	隆华转债	1,014,830.47	0.03
52	113549	白电转债	1,011,813.24	0.03
53	113017	吉视转债	1,010,520.69	0.03
54	127036	三花转债	991,594.11	0.03
55	123129	锦鸡转债	977,363.61	0.03
56	128075	远东转债	971,193.53	0.03

57	128066	亚泰转债	969,831.75	0.03
58	127019	国城转债	924,382.27	0.03
59	113011	光大转债	851,740.61	0.03
60	110083	苏租转债	847,361.89	0.03
61	123049	维尔转债	813,184.74	0.03
62	128081	海亮转债	699,375.47	0.02
63	110053	苏银转债	624,858.22	0.02
64	111000	起帆转债	567,798.29	0.02
65	110045	海澜转债	327,491.10	0.01
66	110043	无锡转债	182,765.30	0.01
67	113532	海环转债	159,709.82	0.01
68	128034	江银转债	147,005.39	0.00

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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 (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 (%)
3	969,999,333.33	2,909,998,000.00	100.0000	-	-

### 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	0.00	0.0000

### 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额 占基 金总 份 额 比 例 (%)	发起份 额总 数	发起份 额占 基 金总 份 额 比 例 (%)	发起份 额承 诺持 有 期 限

基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.3436	10,000,000.00	0.3436	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	2,899,998,000.00	99.6564	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	2,909,998,000.00	100.0000	10,000,000.00	0.3436	3 年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 6 月 24 日） 基金份额总额	2,909,998,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,909,998,000.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,909,998,000.00

## § 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

(1) 本基金管理人于 2022 年 1 月 21 日发布公告，自 2022 年 1 月 19 日起季勇先生不再担任公司助理总经理职务。

(2) 本基金管理人于 2022 年 6 月 11 日发布公告，自 2022 年 6 月 10 日起董晓亮先生担任公司副总经理。

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。

### 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发生改变。

#### 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，本基金、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。

#### 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 (%)	
国金证券	1	332,076,821.06	32.88	255,369.41	34.10	-
长江证券	1	306,146,454.07	30.31	218,136.85	29.13	-
广发证券	1	194,307,368.93	19.24	145,637.70	19.45	-
华创证券	2	177,556,796.44	17.58	129,744.88	17.32	-

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

本基金本报告期内新增国金证券交易单元。

### 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 (%)
国金证券	217,682,392.60	11.34	9,130,665,000.00	31.29	-	-
长江证券	537,254,350.82	27.99	7,883,655,000.00	27.02	-	-
广发证券	1,048,785,562.50	54.64	4,698,800,000.00	16.10	-	-
华创证券	115,883,377.48	6.04	7,469,320,000.00	25.60	-	-

### 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基金改聘会计师事务所公告	指定报刊、基金管理人网站	2022 年 01 月 21 日
2	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年第四季度报告	指定报刊、基金管理人网站	2022 年 01 月 24 日
3	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2021 年年度报告	指定报刊、基金管理人网站	2022 年 03 月 30 日
4	太平基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销费率优惠活动的公告	指定报刊、基金管理人网站	2022 年 04 月 01 日
5	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2022 年第 1 号）	指定报刊、基金管理人网站	2022 年 04 月 20 日
6	太平丰泰一年定期开放债券型发起式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	2022 年 04 月 20 日
7	太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2022 年第一季度报告	指定报刊、基金管理人网站	2022 年 04 月 22 日
8	关于太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回等业务公告	指定报刊、基金管理人网站	2022 年 06 月 21 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
------	----------------	------------



别	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	20220101— 20220630	2,899,998,000.00	-	-	2,899,998,000.00	99.6564
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：报告期末同一投资者通过多个基金账户持有本基金的合并计算。

## 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、《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

### 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

太平基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日