

# 太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资 基金

## 2021 年年度报告

2021 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：2022 年 3 月 30 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 2022 年 3 月 28 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 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 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             | 13        |
| 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 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 | 15        |
| 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      | 15        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>18</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 18        |
| 7.2 利润表                                 | 19        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 20        |
| 7.4 报表附注                                | 22        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 44        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 45        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....     | 45        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 45        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 45        |
| 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 .....    | 46        |
| 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 ..... | 46        |
| 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 ..... | 46        |
| 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 .....    | 46        |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 46        |
| 8.11 投资组合报告附注 .....                         | 46        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>47</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 47        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 47        |
| 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 .....      | 48        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>48</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>48</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 48        |
| 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 .....      | 48        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 49        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 49        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 49        |
| 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 .....         | 49        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 49        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 50        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>50</b> |
| 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 .....    | 50        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 51        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>51</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 51        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 51        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 51        |

## § 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 | 8,000,016,747.46 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 | <p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）封闭期配置策略</p> <p>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，所投资金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日（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。</p> <p>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。</p> <p>（2）信用债投资策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>(3) 放大策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(4) 资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>(5) 封闭期现金管理策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>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%。</p> <p>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。</p>  |
| 风险收益特征 | <p>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。</p>  |

### 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<br>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 | 焦艳军                          | 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 | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 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 | 2021 年           | 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       | 291,428,149.46   | 101,551,049.15                             |
| 本期利润          | 291,428,149.46   | 101,551,049.15                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0364           | 0.0127                                     |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.55%            | 1.26%                                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.61%            | 1.27%                                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末          | 2020 年末                                    |
| 期末可供分配利润      | 240,978,893.67   | 101,551,049.15                             |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0301           | 0.0127                                     |
| 期末基金资产净值      | 8,240,995,641.13 | 8,101,567,453.35                           |

|              |         |         |
|--------------|---------|---------|
| 期末基金份额净值     | 1.0301  | 1.0127  |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2021 年末 | 2020 年末 |
| 基金份额累计净值增长率  | 4.93%   | 1.27%   |

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

2、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

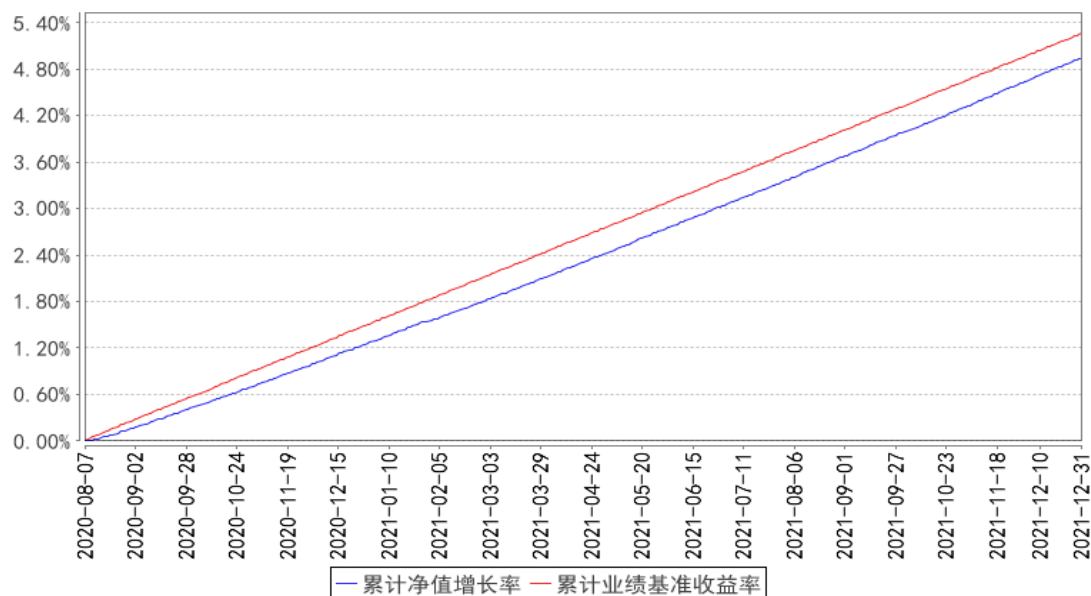
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | 0.91%    | 0.01%       | 0.95%      | 0.01%         | -0.04% | 0.00% |
| 过去六个月      | 1.84%    | 0.01%       | 1.89%      | 0.01%         | -0.05% | 0.00% |
| 过去一年       | 3.61%    | 0.01%       | 3.75%      | 0.01%         | -0.14% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.93%    | 0.01%       | 5.26%      | 0.01%         | -0.33% | 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

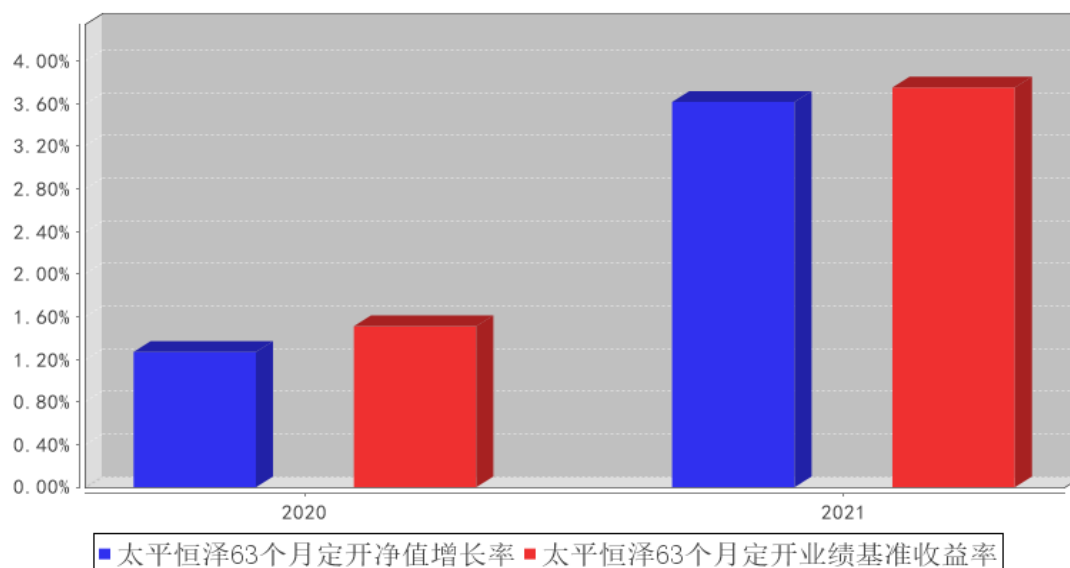
太平恒泽63个月定开累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效期为 2020 年 8 月 7 日，建仓期为基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。图示日期为 2020 年 8 月 7 日至 2021 年 12 月 31 日。

### 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

太平恒泽63个月定开基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

单位：人民币元

| 年度     | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计       | 备注 |
|--------|---------------|----------------|-----------|----------------|----|
| 2021 年 | 0.1900        | 151,999,961.68 | 351.94    | 152,000,313.62 | -  |
| 2020 年 | -             | -              | -         | -              | -  |
| 合计     | 0.1900        | 151,999,961.68 | 351.94    | 152,000,313.62 | -  |

## § 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 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 25 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。

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、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、太 | 2020年08月07日     | -    | 8 年    | 美国本特利商学院金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 5 月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公司担任部门经理、投资总监等职。2017 年 3 月加入本公司。2018 年 2 月 12 日起任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2019 年 3 月 25 日担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 27 日起任太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 28 日起任太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 7 日起担任太平洋恒泽 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。 |

|  |                  |  |  |  |  |
|--|------------------|--|--|--|--|
|  | 平睿享混合型证券投资基金基金经理 |  |  |  |  |
|--|------------------|--|--|--|--|

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

2021 年整体经济相比 2020 年平稳复苏，逐渐走出疫情影响。2021 年基本面的核心矛盾是信用收缩带来的经济下行。2020 年底中央经济工作会议指出要“抓实化解地方政府隐性债务风险工作”，财政发力不及预期，2021 年“三道红线”全行业全面实施、贷款集中度考核落地，地产行业融资端面对更加严格和规范的管理，企业融资需求走弱，社融同比从 13% 下降至 10%，经济也逐渐走弱。从资金面来看，2021 年除了 1 月份为应对杠杆率的抬升而短暂收紧外，货币政策总体维持稳健偏宽松的基调。7 月份，经济尚未出现明显下行压力，但央行开展了降准的操作，明显超出市场的预期，也与以往周期中的经济先下行、货币后宽松的操作不同，体现了货币政策跨周期调节的特征；而央行降准之后，资金利率并未明显宽松，对货币政策进一步宽松期待的落空带来了债券收益率在 9-10 月的快速上行；12 月央行再次降准超出市场预期，收益率再度出现下行。纵观全年来看，债券收益率震荡下行。

在报告期内，本基金主要配置符合期限要求的政策性银行金融债，积极运用杠杆策略，取得了较好的风险收益比。

### 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 3.61%，同期业绩比较基准收益率为 3.75%。

## 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 2022 年，上半年的稳增长压力较大，需要货币政策与财政政策协同发力，在银行间市场保持流动性合理充裕、在信贷层面进行结构性支持。2022 年 1 月央行已经实施降息操作，预计年内仍将有货币政策延续出台。从财政政策来看，2022 年财政发力是大概率事件，但由于 3% 的赤字率红线和 60% 的负债率红线的限制已经成为控制财政风险、金融风险的重要考量，也是直接影响市场预期的前瞻指引，所以仍将强调财政的效能提升，同时也会避免重走老路（地产强刺激）。

对于债券市场而言，由于宏观经济潜在中枢下移，经济增速波动性减弱；货币政策跨周期调

节，整体维持稳定偏宽松的格局；流动性平稳且波动性降低，因此判断债市延续 2021 年的低波动特征，且波动幅度收窄。2022 年上半年债市面临的环境是经济下行+货币宽松，宽信用政策发力但社融反弹幅度有限，债券市场并非熊市，而是面临类似于 2012 年上半年/2015 年上半年/2019 年上半年的宏观环境，总体以震荡为主，阶段性存在收益率下行的机会（触发因素在于经济数据下行、货币政策的宽松）。2022 年下半年，随着经济内生动能企稳，存在货币政策收敛的风险。

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

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金资产的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值和产品委员会成员由主席负责，估值分委会常任委员由稽核风控部、投资部门（含权益投资部、专户业务部、固定收益投资部）、研究部、基金运营部等部门负责人担任。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

根据法律法规的规定及《太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金》的约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%。本基金管理人在本报告期内实施两次分红，一次分红方案为：每 10 份基金发放红利 0.1 元，二次分红方案为：每 10 份基金发放红利 0.09 元。

#### 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遵规守信、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的真实、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     | 毕马威华振审字第 2201218 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      | <p>我们审计了后附的太平恒泽 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 个月定开基金”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 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”）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编制，公允反映了太平恒泽 63 个月定开基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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。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 个月定开基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>  |
| 强调事项      | —   |
| 其他事项      | —   |
| 其他信息      | <p>太平恒泽 63 个月定开基金管理人太平基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括太平恒泽 63 个月定开基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告</p>              |



|                        |   |
|------------------------|---|
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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。</p> <p>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，除非太平恒泽 63 个月定开基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督太平恒泽 63 个月定开基金的财务报告过程。</p>  |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>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。</p> <p>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：</p> <p>(1) 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。</p> <p>(2) 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。</p> <p>(3) 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。</p> <p>(4) 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，就可能对导致对太平恒泽 63 个月定开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 个月定开基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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。</p> <p>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。</p> |

|           |                           |    |
|-----------|---------------------------|----|
| 会计师事务所的名称 | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)       |    |
| 注册会计师的姓名  | 张楠                        | 鲍涵 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼 |    |
| 审计报告日期    | 2022 年 03 月 28 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 84,994,680.23                   | 18,746,950.52                    |
| 结算备付金           |            | 52,862,302.26                   | 3,264,584.69                     |
| 存出保证金           |            | 45,272.51                       | 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    | 175,898,913.92                  | 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    | 14,462,512,585.49               | 10,339,566,857.12                |
| 资产总计            |            | 14,776,313,754.41               | 10,561,371,793.07                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 6,448,262,874.29                | 2,439,845,739.01                 |
| 应付证券清算款         |            | 83,145,980.74                   | 17,467,822.22                    |
| 应付赎回款           |            | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 1,052,467.55                    | 1,027,742.28                     |

|               |          |                   |                   |
|---------------|----------|-------------------|-------------------|
| 应付托管费         |          | 350,822.53        | 342,580.78        |
| 应付销售服务费       |          | -                 | -                 |
| 应付交易费用        | 7.4.7.7  | 66,908.58         | 80,362.45         |
| 应交税费          |          | -                 | -                 |
| 应付利息          |          | 2,277,059.59      | 800,092.98        |
| 应付利润          |          | -                 | -                 |
| 递延所得税负债       |          | -                 | -                 |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 162,000.00        | 240,000.00        |
| 负债合计          |          | 6,535,318,113.28  | 2,459,804,339.72  |
| <b>所有者权益：</b> |          |                   |                   |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 8,000,016,747.46  | 8,000,016,404.20  |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 240,978,893.67    | 101,551,049.15    |
| 所有者权益合计       |          | 8,240,995,641.13  | 8,101,567,453.35  |
| 负债和所有者权益总计    |          | 14,776,313,754.41 | 10,561,371,793.07 |

注：1. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0301 元，基金份额总额 8,000,016,747.46 份。

2. 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号        | 本期                               | 上年度可比期间                                   |
|-------------------|------------|----------------------------------|---|
|                   |            | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 8 月 7 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日 |
| 一、收入              |            | 414,367,189.93                   | 121,334,692.63                            |
| 1. 利息收入           |            | 414,367,189.93                   | 121,334,692.63                            |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.11   | 584,193.76                       | 1,303,053.14                              |
| 债券利息收入            |            | 413,708,196.24                   | 113,586,171.16                            |
| 资产支持证券利息收入        |            | -                                | -   |
| 买入返售金融资产收入        |            | 74,799.93                        | 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          | 7.4.7.13.5 | -                                | -   |

|                        |            |                |                |
|------------------------|------------|----------------|----------------|
| 收益                     |            |                |                |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -              | -              |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -              | -              |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | -              | -              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | -              | -              |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -              | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | -              | -              |
| 减：二、费用                 |            | 122,939,040.47 | 19,783,643.48  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 12,298,455.05  | 4,815,197.42   |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 4,099,485.01   | 1,605,065.80   |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | -              | -              |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.19   | -              | -              |
| 5. 利息支出                |            | 106,282,900.41 | 13,121,480.26  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 106,282,900.41 | 13,121,480.26  |
| 6. 税金及附加               |            | -              | -              |
| 7. 其他费用                | 7.4.7.20   | 258,200.00     | 241,900.00     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 291,428,149.46 | 101,551,049.15 |
| 减：所得税费用                |            | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 291,428,149.46 | 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 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                       | 101,551,049.15 | 8,101,567,453.35 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | -                                      | 291,428,149.46 | 291,428,149.46   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数     | 343.26                                 | 8.68           | 351.94           |

|  |   |                 |                  |
|--|---|-----------------|------------------|
| (净值减少以“-”号填列)                          |   |                 |                  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 343.26                                    | 8.68            | 351.94           |
| 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) | -   | -152,000,313.62 | -152,000,313.62  |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 8,000,016,747.46                          | 240,978,893.67  | 8,240,995,641.13 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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>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    |

## 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 2022 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 7.4.2 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金采用买入并持有至到期的投资策略，因此将所持有的债权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。持有至到期投资按照摊余成本进行计量，在其他资产中进行核算。

#### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 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；

- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

以摊余成本计量的金融资产按下述原则评估减值损失：

- 本基金在资产负债表日对以摊余成本计量的金融资产的账面价值进行检查，有客观证据表明该金融资产发生减值的，计提减值准备；

- 当以摊余成本计量的金融资产的预计未来现金流量（不包括尚未发生的未来信用损失）按原实际利率折现的现值低于其账面价值时，本基金将该以摊余成本计量的金融资产的账面价值减记至该现值，减记的金额确认为资产减值损失，计入当期损益；

- 在以摊余成本计量的金融资产确认减值损失后，如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，本基金将原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。该转回后的账面价值不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。



#### 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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

#### 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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金每一基金份额享有同等分配权。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 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。持有至到期投资已发生减值的证据包括下列可观察信息：

- 发行方或债务人发生严重财务困难；
- 债务人违反了合同条款，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 债务人很可能倒闭或进行其他财务重组；
- 因发行方发生重大财务困难，该金融资产无法在活跃市场继续交易。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》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) 证券投资基金管理人运用基金买卖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。

2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)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债券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) 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。

(d) 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。

#### 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<br>2021 年 12 月 31 日 |               | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |               |
|----------------|-------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
|                | 活期存款                    | 84,994,680.23 |                          | 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             | 84,994,680.23           |               | 18,746,950.52            |               |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

本基金于本期末及上年度末均未持有任何交易性金融资产。

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/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<br>2021 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 | -                        | -         |
| 合计    | -                        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>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

本基金于本期末及上年度末均无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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 4,337.29                | 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  | 26,166.91               | 1,616.01                 |
| 应收债券利息     | 175,868,387.28          | 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         | 22.44                   | 0.55                     |
| 合计         | 175,898,913.92          | 139,847,210.05           |

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目      | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------|--------------------------|
| 其他应收款   | -                       | -                        |
| 待摊费用    | -                       | -                        |
| 持有至到期投资 | 14,462,512,585.49       | 10,339,566,857.12        |
| 合计      | 14,462,512,585.49       | 10,339,566,857.12        |

注：本基金持有的持有至到期投资均为债券投资，其中持有交易所市场债券人民币 4,371,707,952.93 元，银行间市场债券人民币 10,090,804,632.56 元（2020 年 12 月 31 日：交易所市场债券人民币 463,662,790.63 元，银行间市场债券人民币 9,875,904,066.49 元）。于 2021 年 12 月 31 日，上述持有至到期投资无需计提减值准备（2020 年 12 月 31 日：无）。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>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 | 66,908.58               | 80,362.45                |
| 合计          | 66,908.58               | 80,362.45                |

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>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 | 120,000.00 |
| 预提审计费     |  | 42,000.00  | 120,000.00 |
| 合计        |  | 162,000.00 | 240,000.00 |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                               |                  |
|---------------|----------------------------------|------------------|
|               | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                  |
|               | 基金份额（份）                          | 账面金额             |
| 上年度末          | 8,000,016,404.20                 | 8,000,016,404.20 |
| 本期申购          | 343.26                           | 343.26           |
| 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           | 8,000,016,747.46                 | 8,000,016,747.46 |

注：1. 此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

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》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。

#### 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         |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末           | 101,551,049.15  | -     | 101,551,049.15  |
| 本期利润           | 291,428,149.46  | -     | 291,428,149.46  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8.68            | -     | 8.68            |
| 其中：基金申购款       | 8.68            | -     | 8.68            |
| 基金赎回款          | -               | -     | -               |
| 本期已分配利润        | -152,000,313.62 | -     | -152,000,313.62 |
| 本期末            | 240,978,893.67  | -     | 240,978,893.67  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>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  | 125,148.91                             | 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 | 458,252.22                             | 403,490.13   |
| 其他        | 792.63                                 | 4.51   |
| 合计        | 584,193.76                             | 1,303,053.14   |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——买卖股票差价收入。

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益—申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无交易费用。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年8月7日（基金合同生效日）至<br>2020年12月31日 |
|---------|---------------------------------|---|
| 审计费用    | 42,000.00                       | 120,000.00                                    |
| 信息披露费   | 120,000.00                      | 120,000.00                                    |
| 证券出借违约金 | -                               | -   |
| 开户费     | -                               | 400.00  |



|         |            |            |
|---------|------------|------------|
| 债券账户维护费 | 37,200.00  | 1,500.00   |
| 其他      | 59,000.00  | -          |
| 合计      | 258,200.00 | 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

(1) 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。

(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》、《太平基金管理有限公司太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》、《太平基金管理有限公司关于太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告》规定，基金管理人太平基金管理有限公司于 2022 年 1 月 25 日(权益登记日)，对本基金进行了分红除权。分红结果如下：权益登记日 2022 年 1 月 25 日，除息日 2022 年 1 月 25 日，现金红利发放日 2022 年 1 月 26 日，每 10 份基金份额分红人民币 0.21 元。

(3) 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》、《太平基金管理有限公司太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》、《太平基金管理有限公司关于太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告》规定，基金管理人太平基金管理有限公司于 2022 年 3 月 28 日(权益登记日)，对本基金进行了分红除权。分红结果如下：权益登记日 2022 年 3 月 28 日，除息日 2022 年 3 月 28 日，现金红利发放日 2022 年 3 月 29 日，每 10 份基金份额分红人民币 0.10 元。

除以上情况外，本基金无其他需要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(以下简称“太平基金”) | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”) | 基金托管人、基金销售机构        |
| 太平资产管理有限公司(以下简称“太平资产”) | 基金管理人的股东            |

|                         |          |
|-------------------------|----------|
| 资管” )                   |          |
| 安石投资管理有限公司(以下简称“安石投资” ) | 基金管理人的股东 |

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没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<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>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  | 12,298,455.05               | 4,815,197.42                              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10.95                       | 4.38                                      |

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 0.15%的年费率

计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                                   |
|----------------|----------------------------------|---|
|                | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 | 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 | 4,099,485.01                     | 1,605,065.80                              |

注：支付基金托管行交通银行的基金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。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

#### 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  |                |      |       |      |       |      |
|---|----------------|------|-------|------|-------|------|
| 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 |
| -   | -              | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间                                   |                |      |       |      |       |      |
| 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 | -    | -     | -    | -     | -    |

注：本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间未持有过本基金。

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2021年12月31日 |                                 | 上年度末<br>2020年12月31日 |                                 |
|-------|--------------------|---------------------------------|---------------------|---------------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额        | 持有的基金份额<br>占基金总份<br>额的比例<br>(%) | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份<br>额的比例<br>(%) |
| 交通银行  | 499,999,000.00     | 6.2500                          | 499,999,000.00      | 6.2500                          |

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

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>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     | 期末余额                                      | 当期利息收入     |
| 交通银行  | 84,994,680.23               | 125,148.91 | 18,746,950.52                             | 899,558.50 |

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2021年12月31日的相关余额为人民币52,862,302.26元。（2020年12月31日：人民币3,264,584.69元）

##### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

##### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

##### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日            | 除息日 |                  | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计       | 备注 |
|----|------------------|-----|------------------|---------------|----------------|-----------|----------------|----|
|    |                  | 场内  | 场外               |               |                |           |                |    |
| 1  | 2021 年 6 月 23 日  | -   | 2021 年 6 月 23 日  | 0.1000        | 79,999,979.84  | 184.24    | 80,000,164.08  | -  |
| 2  | 2021 年 12 月 14 日 | -   | 2021 年 12 月 14 日 | 0.0900        | 71,999,981.84  | 167.70    | 72,000,149.54  | -  |
| 合计 | -                | -   | -                | 0.1900        | 151,999,961.68 | 351.94    | 152,000,313.62 | -  |

注：本基金 2022 年 1 月 24 日、2022 年 3 月 25 日有分红公告。

#### 7.4.12 期末(2021 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

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。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2021 年 12 月 31 日，本基金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 2021 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人民币 2,617,134,874.29 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         |
|--------|----------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 200405 | 20 农发 05 | 2022 年 1 月 4 日 | 96.53  | 8,800,000 | 849,447,470.32 |

|        |          |                |        |            |                  |
|--------|----------|----------------|--------|------------|------------------|
| 200405 | 20 农发 05 | 2022 年 1 月 6 日 | 96.53  | 960,000    | 92,666,996.76    |
| 150314 | 15 进出 14 | 2022 年 1 月 4 日 | 101.74 | 7,820,000  | 795,618,408.16   |
| 150314 | 15 进出 14 | 2022 年 1 月 7 日 | 101.74 | 10,180,000 | 1,035,728,311.39 |
| 合计     |          |                |        | -          | 2,773,461,186.63 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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人民币 3,831,128,000.00 元,于 2022 年 1 月 4 日、1 月 6 日、1 月 7 日、1 月 10 日、1 月 12 日、1 月 13 日、1 月 14 日、1 月 28 日、3 月 16 日、3 月 17 日、3 月 31 日、4 月 13 日、4 月 18 日、4 月 27 日、4 月 28 日、4 月 29 日、5 月 5 日、5 月 6 日、5 月 9 日、5 月 10 日、5 月 13 日、5 月 17 日、5 月 18 日、5 月 19 日、5 月 20 日、5 月 23 日、5 月 26 日、5 月 27 日、5 月 30 日、6 月 8 日、6 月 10 日、6 月 17 日和 7 月 1 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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2021 年 12 月 31 日,本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### **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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

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债券。

##### **7.4.13.2.2 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。

##### **7.4.13.2.3 按短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短期信用评级列示的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 303,566,833.34          | -                        |
| AAA 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 14,158,945,752.15       | -                        |
| 合计     | 14,462,512,585.49       | -                        |

注：未评级债券为国债、地方政府债和政策性金融债。

本基金上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长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长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 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。

#### 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 2021 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 6,448,262,874.29 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。

#### 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 2021 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 2021 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<br>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                     | 84,994,680.23            | -                        | -        | -                      | 84,994,680.23            |
| 结算备付金                    | 52,862,302.26            | -                        | -        | -                      | 52,862,302.26            |
| 存出保证金                    | 45,272.51                | -                        | -        | -                      | 45,272.51                |
| 应收利息                     | -                        | -                        | -        | -175,898,913.92        | 175,898,913.92           |
| 其他资产                     | -                        | 14,462,512,585.49        | -        | -                      | 14,462,512,585.49        |
| <b>资产总计</b>              | <b>137,902,255.00</b>    | <b>14,462,512,585.49</b> | <b>-</b> | <b>-175,898,913.92</b> | <b>14,776,313,754.41</b> |
| <b>负债</b>                |                          |                          |          |                        |                          |
| 应付管理人报酬                  | -                        | -                        | -        | 1,052,467.55           | 1,052,467.55             |
| 应付托管费                    | -                        | -                        | -        | 350,822.53             | 350,822.53               |
| 应付证券清算款                  | -                        | -                        | -        | 83,145,980.74          | 83,145,980.74            |
| 卖出回购金融资产款                | 6,448,262,874.29         | -                        | -        | -                      | 6,448,262,874.29         |
| 应付交易费用                   | -                        | -                        | -        | 66,908.58              | 66,908.58                |
| 应付利息                     | -                        | -                        | -        | 2,277,059.59           | 2,277,059.59             |
| 其他负债                     | -                        | -                        | -        | 162,000.00             | 162,000.00               |
| <b>负债总计</b>              | <b>6,448,262,874.29</b>  | <b>-</b>                 | <b>-</b> | <b>87,055,238.99</b>   | <b>6,535,318,113.28</b>  |
| <b>利率敏感度缺口</b>           | <b>-6,310,360,619.29</b> | <b>14,462,512,585.49</b> | <b>-</b> | <b>-88,843,674.93</b>  | <b>8,240,995,641.13</b>  |
| 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 | 1 年以内                    | 1-5 年                    | 5 年以上    | 不计息                    | 合计                       |
| <b>资产</b>                |                          |                          |          |                        |                          |
| 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        |
| <b>资产总计</b>              | <b>81,957,725.90</b>     | <b>10,339,566,857.12</b> | <b>-</b> | <b>-139,847,210.05</b> | <b>10,561,371,793.07</b> |
| <b>负债</b>                |                          |                          |          |                        |                          |
| 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、以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。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。

##### (a) 持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无持续的以公允价值计量的金融工具（2020 年 12 月 31 日：无）。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2020 年 12 月 31 日：无）。

2、其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括持有至到期投资、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债。于 12 月 31 日，除下表中列示的持有至到期投资以外，本基金持有的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之间无重大差异：

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易所市场债券账面价值人民币 4,371,707,952.93 元，公允价值人民币 4,433,006,064.00 元；银行间市场债券账面价值人民币 10,090,804,632.56 元，公允价值人民币 10,313,535,000.00 元；合计持有债券的账面价值人民币 14,462,512,585.49 元，公允价值人民币 14,746,541,064.00 元（2020 年 12 月 31 日：本基金持有的交易所市场债券账面价值人民币 463,662,790.63 元，公允价值人民币 465,468,635.60 元；银行间市场债券账面价值人民币 9,875,904,066.49 元，公允价值人民币 9,945,619,000.00 元；合计持有债券的账面价值人民币 10,339,566,857.12 元，公允价值人民币 10,411,087,635.60 元。）

除特别声明外，本基金按下述原则确认公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

根据《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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## § 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 | 14,462,512,585.49 | 97.88         |

|   |                   |                   |        |
|---|-------------------|-------------------|--------|
|   | 其中：债券             | 14,462,512,585.49 | 97.88  |
|   | 资产支持证券            | -                 | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -                 | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -                 | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -                 | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 137,856,982.49    | 0.93   |
| 8 | 其他各项资产            | 175,944,186.43    | 1.19   |
| 9 | 合计                | 14,776,313,754.41 | 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初基金资产净值 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初基金资产净值 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      | 497,038,168.01    | 6.03          |
| 2  | 央行票据      | -                 | -             |
| 3  | 金融债券      | 13,099,677,212.71 | 158.96        |
|    | 其中：政策性金融债 | 13,099,677,212.71 | 158.96        |
| 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        | 865,797,204.77    | 10.51  |
| 10 | 合计        | 14,462,512,585.49 | 175.49 |

### 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 | 3,542,582,063.72 | 42.99        |
| 2  | 150314 | 15 进出 14 | 26,750,000 | 2,721,584,708.21 | 33.02        |
| 3  | 018083 | 农发 2001  | 15,216,130 | 1,517,906,108.13 | 18.42        |
| 4  | 108904 | 农发 2102  | 13,980,730 | 1,396,006,949.78 | 16.94        |
| 5  | 200212 | 20 国开 12 | 10,100,000 | 1,008,819,662.82 | 12.24        |

### 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权证。

### 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，中国进出口银行、国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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   | 45,272.51      |
| 2  | 应收证券清算款 | -              |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 175,898,913.92 |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 175,944,186.43 |

### 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

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。

## § 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<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构            |                |           |                |
|--------------|---------------|------------------|----------------|-----------|----------------|
|              |               | 机构投资者            |                | 个人投资者     |                |
|              |               | 持有份额             | 占总份额比<br>例 (%) | 持有份额      | 占总份额比<br>例 (%) |
| 302          | 26,490,121.68 | 7,999,994,000.00 | 99.9997        | 22,747.46 | 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 | 2.02       | 0.0000       |

注：上述占比数据为四舍五入保留小数点后四位结果。

### 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                 |

注：报告期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理均未持有本基金。

## § 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 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 8,000,016,404.20 |
| 本报告期基金总申购份额                   | 343.26           |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）      | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 8,000,016,747.46 |

## § 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 2021 年 9 月 2 日发布公告，自 2021 年 8 月 31 日起：范宇先生担任公司总经理，不再担任公司董事长职务，代为履行公司董事长职务；季勇先生担任公司助理总经理，不再担任公司副总经理职务；史彦刚先生担任公司助理总经理，不再担任公司副总经理职务；尤象都先生不再担任公司总经理职务。

(2) 本基金管理人于 2021 年 9 月 10 日发布公告，自 2021 年 9 月 8 日起：焦艳军先生担任公司董事长，范宇先生不再代为履行公司董事长职务。

(3) 本基金管理人于 2021 年 10 月 16 日发布公告，自 2021 年 10 月 14 日起公司法定代表人变更为焦艳军先生。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。



本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 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

经过邀请招标，并履行适当程序，聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为我司审计机构。本基金本年度应支付审计费肆万贰仟元整。

### 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、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

本报告期内，基金租用证券公司交易单元无变化。

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 | 2,663,487,113.05 | 100.00%      | 84,170,437,000.00 | 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招募说明书更新                   | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 07 月 27 日 |
| 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更新                    | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 07 月 27 日 |
| 3  | 太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议更新                    | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 07 月 27 日 |
| 4  | 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 | 2021 年 04 月 20 日 |
| 5  | 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更新（2021 年第 1 号）      | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 04 月 20 日 |
| 6  | 太平基金管理有限公司关于太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告          | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 12 月 13 日 |
| 7  | 太平基金管理有限公司关于太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告          | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 06 月 22 日 |
| 8  | 太平基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金增加侧袋机制并相应修订基金合同有关条款的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2021 年 07 月 27 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 | 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  | 20210101-20211231       | 2,499,999,000.00 |      |      | 2,499,999,000.00 | 31.2499  |
| 机构   | 2  | 20210101-20211231       | 1,999,999,000.00 |      |      | 1,999,999,000.00 | 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

2022 年 3 月 30 日