

太平洋证券 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:太平洋证券股份有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本集合计划管理人的董事会、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。

本集合计划托管人兴业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年8月12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。

本集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利。

本集合计划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集合计划的招募说明书及其更新。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》，本集合计划于2022年4月1日合同变更生效。按照相关法律法规的规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50

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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划	
基金简称	太平洋证券30天滚动持有债券	
基金主代码	970142	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年04月01日	
基金管理人	太平洋证券股份有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,059,754,052.65份	
基金合同存续期	3年	
下属分级基金的基金简称	太平洋证券30天滚动持有债券A	太平洋证券30天滚动持有债券C
下属分级基金的交易代码	970142	970143
报告期末下属分级基金的份额总额	974,816,536.13份	84,937,516.52份

注：本报告所述“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持投资组合低风险和较高流动性的前提下，追求集合计划资产长期稳健的增值。
投资策略	本集合计划将密切关注宏观经济及债券市场运行情况，动态调整类属资产配置比例，并通过自下而上精选债券，力争获取优化收益。本集合计划采取的投资策略主要包括资产配置策略、债券类属配置策略、久期调整策略，收益率曲线配置策略，息差策略。
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产

	管理计划，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。
--	---

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		太平洋证券股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱亚乔	龚小武
	联系电话	010-88321976	021-52629999-212056
	电子邮箱	zhuyaqiao@tpyzq.com	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		95397	95561
传真		010-88321819	021-62159217
注册地址		云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		北京市西城区北展北街九号华远企业中心D座三单元	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码		100044	200120
法定代表人		李长伟	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	https://www.tpyzq.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区北展北街九号华远企业中心D座三单元

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	太平洋证券股份有限公司	云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	太平洋证券30天滚动持有债券A	太平洋证券30天滚动持有债券C
本期已实现收益	14,811,787.14	1,016,205.44
本期利润	16,802,479.29	1,155,083.91
加权平均基金份额本期利润	0.0185	0.0165
本期加权平均净值利润率	1.71%	1.54%
本期基金份额净值增长率	1.74%	1.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	79,943,252.64	6,540,607.10
期末可供分配基金份额利润	0.0820	0.0770
期末基金资产净值	1,060,822,090.60	91,762,440.25
期末基金份额净值	1.0882	1.0804
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	8.53%	7.75%

注：1) 本期已实现收益指本集合计划本期利息收入、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) 上述集合计划业绩指标已扣除了本集合计划的管理费、托管费、销售服务费用（如有）和各项交易费用，但不包括持有人认购或申赎本集合计划的各项费用，计入认购或申赎本集合计划各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

3) 对期末可供分配利润，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余额的孰低数。

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

太平洋证券30天滚动持有债券A

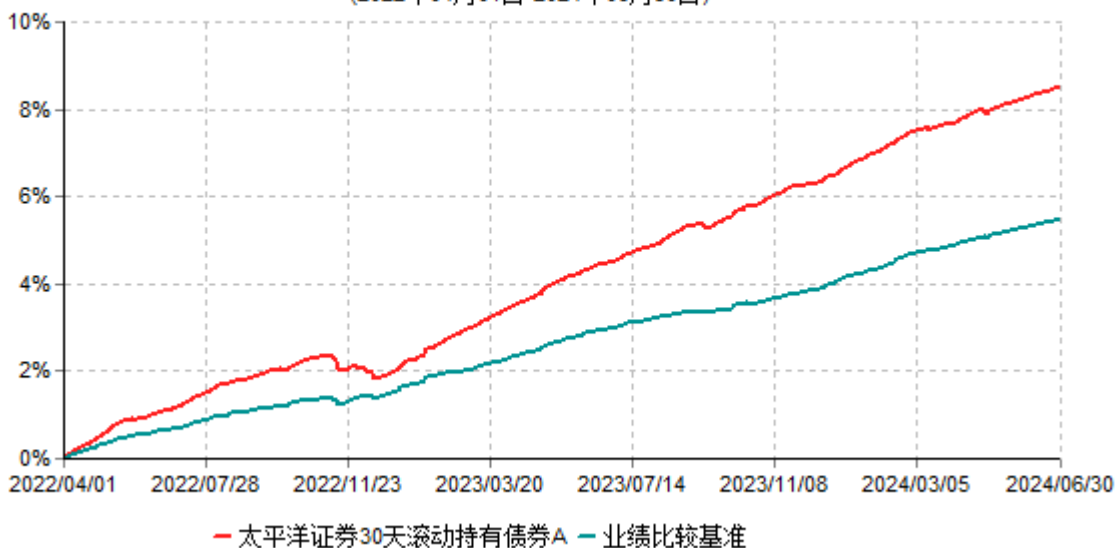
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.26%	0.01%	0.18%	0.01%	0.08%	0.00%
过去三个月	0.80%	0.02%	0.59%	0.01%	0.21%	0.01%
过去六个月	1.74%	0.02%	1.26%	0.01%	0.48%	0.01%
过去一年	3.83%	0.02%	2.40%	0.01%	1.43%	0.01%
自基金合同 生效起至今	8.53%	0.02%	5.48%	0.01%	3.05%	0.01%

太平洋证券30天滚动持有债券C

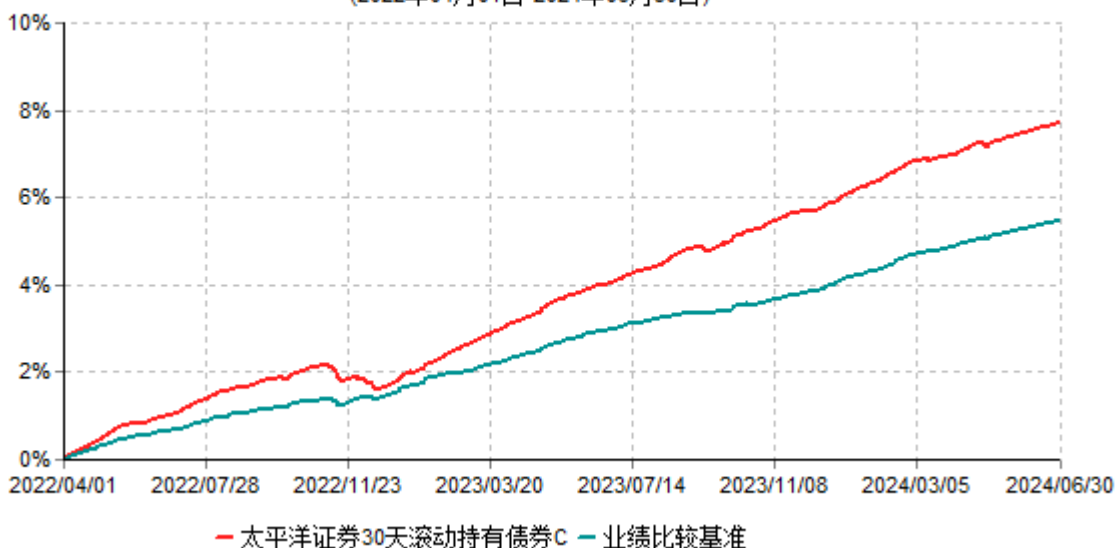
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.24%	0.01%	0.18%	0.01%	0.06%	0.00%
过去三个月	0.73%	0.02%	0.59%	0.01%	0.14%	0.01%
过去六个月	1.60%	0.01%	1.26%	0.01%	0.34%	0.00%
过去一年	3.53%	0.01%	2.40%	0.01%	1.13%	0.00%
自基金合同 生效起至今	7.75%	0.02%	5.48%	0.01%	2.27%	0.01%

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

太平洋证券30天滚动持有债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年04月01日-2024年06月30日)



太平洋证券30天滚动持有债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年04月01日-2024年06月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

太平洋证券股份有限公司（以下简称“太平洋证券”或“公司”）的前身为太平洋证券有限责任公司。经中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）《关于化解云南证券有限责任公司风险及筹建太平洋证券有限责任公司的函》（证监机构字〔2003〕

125号)、《关于同意太平洋证券有限责任公司开业的批复》(证监机构字〔2003〕264号)批准,太平洋证券有限责任公司于2004年1月6日正式注册成立,注册资本6.65亿元,为综合类证券公司,并取得了证券主承销商资格。经中国证监会《关于太平洋证券有限责任公司变更为股份有限公司及增资扩股的批复》(证监机构字〔2007〕81号)批准,2007年4月10日太平洋证券有限责任公司变更为股份有限公司,注册资本14.01亿元。经上海证券交易所《关于太平洋证券股份有限公司人民币普通股股票上市交易的通知》(上证上字〔2007〕220号)批准,公司股票于2007年12月28日在上海证券交易所上市,股票简称“太平洋”,股票代码“601099”。

2012年3月19日,经中国证监会《云南证监局关于核准太平洋证券股份有限公司资产管理业务资格的批复》(云证监〔2012〕65号)批准,同意太平洋证券开展资产管理业务。截至2023年12月,公司受托资产管理规模合计为152.76亿元,与上年末持平。其中集合计划管理规模(份额)117.22亿元。在投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

太平洋证券根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求,截至2023年6月30日,旗下已有两只大集合产品完成公募化改造,分别为“太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”和“太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划”。其中,“太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”已于2023年5月4日完成终止清算。

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		
李岩	投资经理	2022-12-07	-	8	李岩,女,吉林大学法学硕士,8年证券从业经验。2015年6月入职太平洋证券资产管理总部,先后从事债券交易、信用研究工作。无兼职情况。
马赫	投资经理	2022-12-07	-	7	马赫,女,英国杜伦大学理学硕士,7年证券从业经验。2015年4月入职太平洋证券资产管理总部,历任高级项

					目经理、债券交易员。无兼职情况。
--	--	--	--	--	------------------

注：1) 本集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为本集合计划合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2) 非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3) 证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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，本集合计划管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等有关法律法规、监管规定及本集合计划合同、招募说明书等有关法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，在控制风险的基础上，为本集合计划份额持有人谋取最大利益，无损害本集合计划份额持有人利益的行为。

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

本集合计划管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等监管规定制定了《太平洋证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》，完善了公平交易制度及流程，公平对待本集合计划管理人管理的每一个资产管理产品。

本报告期内，本集合计划管理人通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《太平洋证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划未发现异常交易行为。

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

2024年上半年，债市整体情绪较好，收益率整体走低。年前债市投资人抢跑超长债余波仍在，叠加市场强烈的降准降息预期，加之基本面信息披露时滞，超长端带动市场收益率下行。1月24日降准落地后，市场下行幅度继续加深，利率曲线呈现牛平形态。随后，由于股市持续上涨，受股债跷跷板影响，债券市场小幅震荡回调。但在5年期LPR超预期调降25BP的影响下，利率品种率先向下突破，十年与三十年国债均突破历史低点。

3月后，OMO持续减量供应，引发市场对债市空转的担忧，市场情绪有所减弱。4月以来，对于金融业增加值核算方法的调整、对于银行手工补息问题的整改等因素导致金融数据远低于市场预期，同时也导致部分资金向银行理财及非银机构转移，叠加居民、企业风险偏好仍处于低位，使得银行理财和非银机构管理规模大幅增加，对债券资产配置需求较大。5月份，超长期特别国债发行计划落地，发行安排较为平滑，缓解了市场前期对于特别国债集中供给压力的担忧，同时，地方政府专项债发行节奏仍偏慢，地方政府化债仍在持续推进，城投债供给总体收缩。4月末政治局会议提出要统筹研究消化存量房地产的政策措施，5月17号出台了一系列房地产相关政策，随后多地陆续出台了购房调整政策，实际落地效果仍待观察。由于利率债收益率创新低，引发央行对于长期利率债的持续关注，并产生了一定回调，债市收益率整体震荡下行。

2024年上半年，本集合计划负债端较为稳定，在资产配置上，一季度适度提高产品的杠杆率和久期，在维持产品流动性和风险承受能力的前提下，增厚组合收益。二季度以中短久期信用债为底仓，通过利率债、银行二级资本债交易进行收益增厚，考虑到在行情快速演绎的环境中，市场情绪也较为脆弱，易产生震荡，为控制回撤，产品整体维持低杠杆运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末太平洋证券30天滚动持有债券A基金份额净值为1.0882元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.74%，同期业绩比较基准收益率为1.26%；截至报告期末太平洋证券30天滚动持有债券C基金份额净值为1.0804元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.60%，同期业绩比较基准收益率为1.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中央及地方政府面临多种约束条件的情形下，今年以来财政发力不及预期，政府、企业、居民均在寻求安全性、确定性，社会整体风险偏好下降，推动债券收益率下行。今年7月份的三中全会传达了今年要坚定不移实现全年经济社会发展目标，央行已调降政策利率，市场预期后续仍有降准、降息空间，但财政发力仍偏慢，居民收入预期偏弱，下半年面临的外部环境的不确定性在增加，出口或承压，内需和投资仍然看政策，政策的不可预测性与外部环境的不确定性均使资产价格波动的可能性增加，也要求我们对市场可能出现的变化做出灵活应对。

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，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和本集合计划合同的约定，日常估值由集合计划管理人与托管人一同进行，本集合计划份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无

误后由管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与集合计划会计账目的核对同时进行。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》约定，在符合集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配。本集合计划本报告期内未进行利润分配。

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，本集合计划未出现连续二十个工作日本集合计划份额持有人数量不满二百人或者本集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§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，本集合计划托管人在对太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》及其他法律法规、本集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了本集合计划托管人应尽的义务。

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，本集合计划托管人根据国家有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，对本集合计划的管理人--太平洋证券股份有限公司在本集合计划的投资运作、资产净值计算、份额申购赎回价格计算、费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在损害集合计划份额持有人利益的行为。本报告期内，本集合计划未进行利润分配。

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

本集合计划托管人复核审查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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,255,741.48	476,601.27
结算备付金		1,603,142.45	2,300,049.74
存出保证金		4,883.30	16,601.82
交易性金融资产	6.4.7.2	1,193,197,127.17	887,705,271.02
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,193,197,127.17	887,705,271.02
资产支持证券 投资		-	-
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	2,000,020.00	30,923,030.28
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,474,290.80	2,851,677.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,201,535,205.20	924,273,231.23
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
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		45,213,706.92	16,001,618.84
应付清算款		2,000,000.00	4,745.21
应付赎回款		486,041.75	1,068,877.46
应付管理人报酬		559,028.16	457,741.25
应付托管费		46,585.67	38,145.13
应付销售服务费		21,683.05	11,811.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		560,716.34	413,524.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	62,912.46	138,462.06
负债合计		48,950,674.35	18,134,925.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,059,754,052.65	847,444,686.92
未分配利润	6.4.7.8	92,830,478.20	58,693,618.59
净资产合计		1,152,584,530.85	906,138,305.51
负债和净资产总计		1,201,535,205.20	924,273,231.23

注：本集合计划合同生效日为2022年4月1日，本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30日止。报告截止日2024年6月30日，本集合计划总份额1,059,754,052.65份，其中太平洋证券30天滚动持有债券A类份额总额974,816,536.13份，该类份额净值为1.0882元。太平洋证券30天滚动持有债券C类份额总额84,937,516.52份，该类份额净值1.0804元。

6.2 利润表

会计主体：太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		21,948,238.12	16,737,853.27
1.利息收入		55,402.10	63,453.46
其中：存款利息收入	6.4.7.9	19,372.52	26,988.19

债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		36,029.58	36,465.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,763,265.40	13,645,822.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	19,763,265.40	13,645,822.93
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2,129,570.62	3,028,572.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	4.50
减：二、营业总支出		3,990,674.92	2,775,681.87
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,155,242.62	1,792,995.46
2.托管费	6.4.10.2.2	262,936.81	149,416.36
3.销售服务费	6.4.10.2.3	111,734.32	34,275.03
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		301,586.63	656,791.71
其中：卖出回购金融资产支出		301,586.63	656,791.71
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-

7.税金及附加		58,894.15	43,634.28
8.其他费用	6.4.7.18	100,280.39	98,569.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,957,563.20	13,962,171.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,957,563.20	13,962,171.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		17,957,563.20	13,962,171.40

6.3 净资产变动表

会计主体：太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	847,444,686.92	58,693,618.59	906,138,305.51
二、本期期初净资产	847,444,686.92	58,693,618.59	906,138,305.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	212,309,365.73	34,136,859.61	246,446,225.34
（一）、综合收益总额	-	17,957,563.20	17,957,563.20
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	212,309,365.73	16,179,296.41	228,488,662.14

其中：1.基金申购款	546,550,438.78	42,609,279.68	589,159,718.46
2.基金赎回款	-334,241,073.05	-26,429,983.27	-360,671,056.32
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,059,754,052.65	92,830,478.20	1,152,584,530.85
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	459,185,453.13	10,753,618.62	469,939,071.75
二、本期期初净资产	459,185,453.13	10,753,618.62	469,939,071.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	287,110,424.03	24,983,457.22	312,093,881.25
（一）、综合收益总额	-	13,962,171.40	13,962,171.40
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	287,110,424.03	11,021,285.82	298,131,709.85
其中：1.基金申购款	479,799,556.03	18,018,806.38	497,818,362.41
2.基金赎回款	-192,689,132.00	-6,997,520.56	-199,686,652.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产	-	-	-

变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	746,295,877.16	35,737,075.84	782,032,953.00

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：

吴盛生

李国庆

吴文文

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

太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划是由太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划转型而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2022]326号文，准予变更。太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划管理人太平洋证券股份有限公司于2022年3月11日，在管理人官网发布《关于<太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划资产管理合同>变更的公告》。根据公告，“太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划”名称变更为“太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划”，太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划份额转换为太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划份额。合同变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。自2022年4月1日起《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》和《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》生效。本集合计划自资产管理合同生效日起存续期不得超过3年。本集合计划的管理人为太平洋证券股份有限公司（以下简称“太平洋证券”），托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可转换公司债券、可交换债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金等，以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本集合计划不直接投资股票；因持有可转换公司债券、可交换债券转股所得的股票，本集合计划将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，管

理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：债券资产的比例不低于集合计划总资产的80%；投资于可转换公司债券、可交换债券的比例合计不超过集合计划总资产的20%；本集合计划保持不低于集合计划资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本集合计划的业绩比较基准为：中债综合财富(1年以下)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和集合计划净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度采用公历年度，即每年自1月1日至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本集合计划根据其管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本集合计划将金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产的，相关金融资产的合同现金流量特征必须与基本

借贷安排一致，即相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

本集合计划根据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该金融工具或其组成部分分类为金融负债或权益工具。金融负债在初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债、被指定为有效套期工具的衍生工具。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

1、初始确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；以摊余成本计量的金融资产和负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

2、减值

对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

每个资产负债表日，对于处于不同阶段的金融资产的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1. 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2. 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3. 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 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：

- 1、本集合计划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；
- 2、本集合计划计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于本集合计划申购确认日及赎回确认日确认。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金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在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的

金额。损益平准金于集合计划申购确认日或赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

本集合计划在履行了合同中的履约义务，即在客户取得相关商品或服务控制权时确认收入。取得相关商品或服务的控制权，是指能够主导该商品的使用或该服务的提供并从中获得几乎全部的经济利益。

1、利息收入

（1）存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

（2）买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

（3）债券利息收入按实际利率在实际持有期内逐日计提。

2、投资收益

本集合计划持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的红利、股息或现金股利确认当期收益；处置以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具）时所取得价款与该金融资产的账面价值之间的差额，计入投资收益；处置以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产其公允价值与初始入账金额之间的差额，确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

3、其他业务收入

其他业务收入主要是除主营业务活动以外的其他经营活动实现的收入。以合同到期结算时或提供服务时确认为收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

1、本集合计划应给付管理人管理费，按前一日集合计划资产净值的年费率逐日计提，按月支付。本集合计划的年管理费率为0.6%。

2、本集合计划应给付托管人托管费，按前一日集合计划资产净值的年费率逐日计提，按月支付。本集合计划的年托管费率为0.05%。

3、本集合计划A类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费，按前一日集合计划资产净值的年费率逐日计提，按月支付。C类份额的年销售服务费率为0.3%。

4、其他费用：根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

2、本集合计划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相应类别集合计划份额进行再投资；由红利再投所得份额的运作期到期日与原份额的运作期到期日保持一致。若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

3、集合计划收益分配后任一类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本集合计划A类和C类份额的费用收取方式存在不同，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对集合计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，集合计划管理人与集合计划托管人协商一致后,可对集合计划收益分配原则进行调整,并及时公告,不需召开集合计划份额持有人大会。

6.4.4.12 外币交易

无。

6.4.4.13 分部报告

无。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本集合计划根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资集合计划估值业务的指导意见》进行估值。

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

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	2,255,741.48
等于：本金	2,255,594.02
加：应计利息	147.46
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	2,255,741.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	291,785,362.00	6,075,293.16	298,358,803.16	498,148.00
	银行间市场	873,005,446.22	17,912,324.01	894,838,324.01	3,920,553.78
	合计	1,164,790,808.22	23,987,617.17	1,193,197,127.17	4,418,701.78
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,164,790,808.22	23,987,617.17	1,193,197,127.17	4,418,701.78	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本集合计划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 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,020.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,020.00	-

6.4.7.5 其他资产

注：本集合计划本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06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	14,049.91
其中：交易所市场	8,162.56
银行间市场	5,887.35
应付利息	-
预提费用	48,862.55
合计	62,912.46

注：预提费用含预提审计费用、银行间结算费用以及预提信息披露费用。

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 太平洋证券30天滚动持有债券A**

金额单位：人民币元

项目 (太平洋证券30天滚动持有债券A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	803,631,041.52	803,631,041.52
本期申购	474,614,392.71	474,614,392.71
本期赎回(以“-”号填列)	-303,428,898.10	-303,428,898.10
本期末	974,816,536.13	974,816,536.13

6.4.7.7.2 太平洋证券30天滚动持有债券C

金额单位：人民币元

项目 (太平洋证券30天滚动持有债券C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	43,813,645.40	43,813,645.40
本期申购	71,936,046.07	71,936,046.07
本期赎回(以“-”号填列)	-30,812,174.95	-30,812,174.95
本期末	84,937,516.52	84,937,516.52

注：1) 根据《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》和《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》的相关规定，本集合计划的运作方式是契约开放式，对于每份集合计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对于投资者根据原《太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划资产管理合同》参与原集合计划获得的太平洋证券14天现金增益集合资产管理计划份额而言，下同）或该集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或该集合计划份额申购申请日后的第30天（即第一个运作期到期日，如该日为非工作日则顺延至下一个工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至资产管理合同生效日或该集合计划份额申购申请日后的第60天（即第二个运作期到期日，如该日为非工作日则顺延至下一个工作日）止，第三个运作期指第二个运作期到期日的次一日起，至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日后的第90天（即第三个运作期到期日，如该日为非工作日则顺延至下一个工作日）止。以此类推。每个运作期到期日，本集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。本集合计划暂未开通上市交易。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 太平洋证券30天滚动持有债券A

单位：人民币元

项目 (太平洋证券30天滚动 持有债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	52,821,120.89	3,093,327.93	55,914,448.82
本期期初	52,821,120.89	3,093,327.93	55,914,448.82
本期利润	14,811,787.14	1,990,692.15	16,802,479.29
本期基金份额交易产生的变动数	12,310,344.61	978,281.75	13,288,626.36
其中：基金申购款	34,784,667.78	2,683,737.06	37,468,404.84
基金赎回款	-22,474,323.17	-1,705,455.31	-24,179,778.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	79,943,252.64	6,062,301.83	86,005,554.47

6.4.7.8.2 太平洋证券30天滚动持有债券C

单位：人民币元

项目 (太平洋证券30天滚动 持有债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,735,784.92	43,384.85	2,779,169.77
本期期初	2,735,784.92	43,384.85	2,779,169.77
本期利润	1,016,205.44	138,878.47	1,155,083.91
本期基金份额交易产生的变动数	2,788,616.74	102,053.31	2,890,670.05
其中：基金申购款	4,952,483.61	188,391.23	5,140,874.84
基金赎回款	-2,163,866.87	-86,337.92	-2,250,204.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,540,607.10	284,316.63	6,824,923.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	8,797.39
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	10,495.07
其他	80.06
合计	19,372.52

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本集合计划本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	20,284,744.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-521,479.31
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	19,763,265.40

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	395,002,351.75

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	384,035,352.00
减：应计利息总额	11,475,709.49
减：交易费用	12,769.57
买卖债券差价收入	-521,479.31

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：本集合计划本报告期内无资产支持债券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本集合计划本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

注：本集合计划本报告期内无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	2,194,659.97
——股票投资	-
——债券投资	2,194,659.97

—资产支持证券投资	-
—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	65,089.35
合计	2,129,570.62

6.4.7.16 其他收入

注：本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.17 信用减值损失

注：本集合计划本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	9,944.48
信息披露费	59,753.82
证券出借违约金	-
汇划手续费	11,982.09
帐户维护费	600.00
银行结算费用	18,000.00
合计	100,280.39

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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****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
兴业银行股份有限公司	集合计划托管人
太证非凡投资有限公司	集合计划管理人全资子公司
太证资本管理有限责任公司	集合计划管理人全资子公司
太平洋证券股份有限公司	集合计划管理人、登记机构、销售机构

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**

注：本集合计划本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

注：本集合计划本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
太平洋证券股份有限公司	88,286,549.84	100.00%	219,381,955.16	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	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 债券回 购成交 总额的 比例
太平洋证券股份有限公司	1,493,650,000.00	100.00%	1,826,700,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

注：本集合计划本报告期内未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
太平洋证券股份有限公司	15,859.82	100.00%	8,162.56	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

太平洋证券股份有限公司	20,397.30	100.00%	9,988.24	100.00%
-------------	-----------	---------	----------	---------

注：上述佣金参考市场价格经本集合计划的管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的征管费和经手费的净额列示。

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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,155,242.62	1,792,995.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	203,864.82	175,582.67
应支付基金管理人的净管理费	2,951,377.80	1,617,412.79

注：支付集合计划管理人太平洋证券股份有限公司的管理人报酬按前一日集合计划资产净值×0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的集合计划管理费=前一日集合计划资产净值×0.6%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	262,936.81	149,416.36

注：支付集合计划托管人兴业银行股份有限公司的托管人报酬按前一日集合计划资产净值×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的集合计划托管费=前一日集合计划资产净值×0.05%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售	本期
------	----

服务费的各关联方名称	2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平洋证券30天滚动持有债券A	太平洋证券30天滚动持有债券C	合计
太平洋证券股份有限公司	0.00	111,734.32	111,734.32
合计	0.00	111,734.32	111,734.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平洋证券30天滚动持有债券A	太平洋证券30天滚动持有债券C	合计
太平洋证券股份有限公司	0.00	34,275.03	34,275.03
合计	0.00	34,275.03	34,275.03

注：支付集合计划的销售服务费按C类份额前一日资产净值*0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日计提的集合计划销售服务费=C类份额前一日资产净值*0.30%÷当年天数。

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

注：本集合计划本报告期无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

注：本集合计划本报告期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

注：本集合计划本报告期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**

注：本集合计划本报告期无管理人运用固有资金投资本集合计划的情况。

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

注：无。

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	2,255,741.48	8,797.39	3,958,552.86	10,386.97

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人保管，按适用利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本集合计划本报告期未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本集合计划本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

注：本集合计划本报告期未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024年06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**

注：本集合计划本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划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

注：本集合计划本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30日止，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易所形成的卖出回购证券款余额人民币45,199,548.00元，其中：人民币28,699,713.00元于2024年7月1日到期；人民币16,499,835.00元于2024年7月3日到期。该类交易要求本集合计划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

注：本集合计划本报告期期末无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

本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合计划，低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划。主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可转换公司债券、可交换债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金等，以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。日常经营活动中本集合计划面临的风险主要包括：市场风险、管理风险、流动性风险、特定风险、操作或技术风险、合规性风险及其他风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，对风险的识别、判断、评估、跟踪和控制贯穿于资产管理计划投资管理的全过程。本集合计划管理人完善并严格实行投资授权和投资决策机制，定期召开投资决策委员会会议、投资研究会议等会议，防止投资决策的随意性。投资风险控制包括决策过程、执行过程中的风险控制及投资授权控制，通过系统权限控制、岗位分离、集中交易、阈值管理、信息披露等措施来控制投资可能发生的违规风险。

本集合计划管理人资产管理业务按照管理人总经理办公会-资产管理总部的二级体制设立和运行。资产管理总部设立投资决策委员会，是资产管理业务投资管理的决策机构，负责在公司经营管理层的授权范围内对资产管理业务重大事项集体审议决策，投资决策委员会成员须经管理人总经理办公会审议。资产管理总部投资管理实行投资决策委

员会领导下的投资经理负责制，投资经理具体负责资产管理计划的日常投资管理工作，投资经理对其所管理的资产管理计划负有直接责任。本集合计划管理人实行集中交易管理，对交易实施一线监控。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划投资遵循严格的备选库制度，投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，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。

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	30,969,267.75	30,800,281.28
A-1以下	-	-
未评级	272,842,411.06	293,082,638.36
合计	303,811,678.81	323,882,919.64

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级债券为未有第三方机构评级的短期融资券、超短期融资券及期限在一年以内的国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	39,301,068.05	-

合计	39,301,068.05	-
----	---------------	---

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	349,867,897.57	228,039,141.80
AAA以下	122,312,117.70	88,828,120.48
未评级	377,904,365.04	246,955,089.10
合计	850,084,380.31	563,822,351.38

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本报告期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

流动性风险是指管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额在运作周期到期日可以赎回，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。

本集合计划采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。同时公司已经建立以压力测试为核心的开放式集合计划流动性风险监测与预警制度，管理人对集合计划每日和每周净赎回比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。本集合计划主要投资于合同约定的具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在交易所或者银行间市场流动性较好。本集合计划的管理人采用监控集合计划组合资产持仓集中度指标、流动性受限资产比例、集合计划组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。管理人于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，审慎评估不同市场环境下投资者潜在赎回需求，及时调

整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的管理人在集合计划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，控制极端情况下的流动性风险。

本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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。本集合计划主要投资于交易所及银行间市场的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本集合计划的管理人定期对本集合计划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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,255,741.48	-	-	-	2,255,741.48
结算备付金	1,603,142.45	-	-	-	1,603,142.45
存出保证金	4,883.30	-	-	-	4,883.30
交易性金融资产	906,727,366.10	286,469,761.07	-	-	1,193,197,127.17
买入返售金融	2,000,020.00	-	-	-	2,000,020.00

资产					
应收申购款	-	-	-	2,474,290.80	2,474,290.80
资产总计	912,591,153.33	286,469,761.07	-	2,474,290.80	1,201,535,205.20
负债					
卖出回购金融资产款	45,213,706.92	-	-	-	45,213,706.92
应付清算款	-	-	-	2,000,000.00	2,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	486,041.75	486,041.75
应付管理人报酬	-	-	-	559,028.16	559,028.16
应付托管费	-	-	-	46,585.67	46,585.67
应付销售服务费	-	-	-	21,683.05	21,683.05
应交税费	-	-	-	560,716.34	560,716.34
其他负债	-	-	-	62,912.46	62,912.46
负债总计	45,213,706.92	-	-	3,736,967.43	48,950,674.35
利率敏感度缺口	867,377,446.41	286,469,761.07	-	-1,262,676.63	1,152,584,530.85
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资	476,601.27	-	-	-	476,601.27

金					
结算备付金	2,300,049.74	-	-	-	2,300,049.74
存出保证金	16,601.82	-	-	-	16,601.82
交易性金融资产	672,272,878.66	215,432,392.36	-	-	887,705,271.02
买入返售金融资产	30,923,030.28	-	-	-	30,923,030.28
应收申购款	-	-	-	2,851,677.10	2,851,677.10
资产总计	705,989,161.77	215,432,392.36	-	2,851,677.10	924,273,231.23
负债					
卖出回购金融资产款	16,001,618.84	-	-	-	16,001,618.84
应付清算款	-	-	-	4,745.21	4,745.21
应付赎回款	-	-	-	1,068,877.46	1,068,877.46
应付管理人报酬	-	-	-	457,741.25	457,741.25
应付托管费	-	-	-	38,145.13	38,145.13
应付销售服务费	-	-	-	11,811.70	11,811.70
应交税费	-	-	-	413,524.07	413,524.07
其他负债	-	-	-	138,462.06	138,462.06
负债总计	16,001,618.84	-	-	2,133,306.88	18,134,925.72

利率敏感度缺口	689,987,542.93	215,432,392.36	-	718,370.22	906,138,305.51
---------	----------------	----------------	---	------------	----------------

注：表中所示为本集合计划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	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升25个基点	-2,357,546.81	-1,614,597.08
	市场利率下降25个基点	2,371,506.00	1,620,797.75

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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划主要投资于上市交易的证券，其他价格风险主要为市场价格变化或波动，或者单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响。

本集合计划严格按照集合计划合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控，定期对本集合计划进行风险度量，及时地跟踪和控制其他价格风险。本集合计划主要投资于固定收益类金融工具，未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本集合计划资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,193,197,127.17	103.52	887,705,271.02	97.97
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,193,197,127.17	103.52	887,705,271.02	97.97

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	1,193,197,127.17	887,705,271.02
第三层次	-	-

合计	1,193,197,127.17	887,705,271.02
----	------------------	----------------

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本集合计划分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至本报告期末，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,193,197,127.17	99.31
	其中：债券	1,193,197,127.17	99.31
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,000,020.00	0.17

	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	3,858,883.93	0.32
8	其他各项资产	2,479,174.10	0.21
9	合计	1,201,535,205.20	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本集合计划本报告期末投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本集合计划本报告期末投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

注：本集合计划本报告期末投资股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

注：本集合计划本报告期末投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本集合计划本报告期末投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	11,130,802.43	0.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	186,937,279.66	16.22
	其中：政策性金融债	92,750,408.11	8.05
4	企业债券	338,960,320.82	29.41
5	企业短期融资券	292,680,876.38	25.39
6	中期票据	324,186,779.83	28.13
7	可转债(可交换债)	-	-

8	同业存单	39,301,068.05	3.41
9	其他	-	-
10	合计	1,193,197,127.17	103.52

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	1928028	19中国银行二级01	300,000	31,057,704.92	2.69
2	210406	21农发06	300,000	30,812,426.23	2.67
3	185891	22安信C1	250,000	25,283,883.56	2.19
4	102381735	23河北国控MTN001	200,000	21,843,016.39	1.90
5	2028038	20中国银行二级01	200,000	21,177,803.28	1.84

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

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：根据本集合计划合同约定，投资范围不包括贵金属。

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

注：根据本集合计划合同约定，投资范围不包括权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本集合计划本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本集合计划本报告期末未投资国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本集合计划本报告期末未投资国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体中本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本集合计划本报告期期末未持有股票，不存在投资的前十名股票超出本集合计划资产管理合同规定备选股票库的情况。

7.12.3 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	4,883.30
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,474,290.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,479,174.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本集合计划本报告期末无处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本集合计划本报告期末投资股票。

7.12.6 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，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

份额级别	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
太平洋证券30天滚动持有债券A	6,646	146,677.18	31,247,536.68	3.21%	943,568,999.45	96.79%
太平洋证券30天滚动持有债券C	816	104,090.09	9,256,575.34	10.90%	75,680,941.18	89.10%
合计	7,462	142,020.11	40,504,112.02	3.82%	1,019,249,940.63	96.18%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	太平洋证券30天滚动持有债券A	4,308,593.60	0.44%
	太平洋证券30天滚动持有债券C	1,369,421.19	1.61%
	合计	5,678,014.79	0.54%

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	份额级别	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	太平洋证券30天滚动持有债券A	0~10
	太平洋证券30天滚动持有债券C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	太平洋证券30天滚动持有债券A	0
	太平洋证券30天滚动持有债券C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	太平洋证券30天滚动持有债券A	太平洋证券30天滚动持有债券C
基金合同生效日(2022年04月01日)基金份额总额	596,304,702.71	-
本报告期期初基金份额总额	803,631,041.52	43,813,645.40
本报告期基金总申购份额	474,614,392.71	71,936,046.07
减：本报告期基金总赎回份额	303,428,898.10	30,812,174.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	974,816,536.13	84,937,516.52

§10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内无集合计划份额持有人大会决议。

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

本报告期内，集合计划管理人的资产管理部门未发生重大人事变动；无涉及集合计划托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本集合计划管理业务、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无集合计划投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘会计师事务所。

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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员因基金管理业务相关行为受到监管部门稽查或重大行政处罚等情况。

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	
太平洋证券	3	-	-	15,859.82	100.00%	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例

太平洋证 券	88,286,549. 84	100.00%	1,493,650,000. 00	100.00%	-	-	-	-
-----------	-------------------	---------	----------------------	---------	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	太平洋证券股份有限公司关于太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划开通直销柜台渠道且实施申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-05
2	太平洋证券股份有限公司关于太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划2023年第4季度报告	中国证监会指定网站	2024-01-19
3	太平洋证券股份有限公司关于太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划2023年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊	2024-01-19
4	太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划暂停申购公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-07
5	太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划恢复申购公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-19
6	太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划2023年年度报告	中国证监会指定网站	2024-03-29
7	太平洋证券股份有限公司关于太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划2023年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊	2024-03-29
8	太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划2024	中国证监会指定网站	2024-04-19

	年第1季度报告		
9	太平洋证券股份有限公司关于太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划2024年第1季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊	2024-04-19
10	太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划产品资料概要更新	中国证监会指定网站	2024-06-29
11	太平洋证券股份有限公司关于太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划更新产品资料概要的提示性公告	中国证监会指定报刊	2024-06-29

§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

注：本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有本集合计划份额比例达到或超过20%的情况。

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、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新；
- 4、《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 5、《太平洋证券30天滚动持有债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新；
- 6、管理人业务资格批复、营业执照；
- 7、报告期内在规定媒介上公开披露的各项公告。

12.2 存放地点

管理人处。

12.3 查阅方式

投资者可登录管理人网站查询，或在营业时间内至管理人的办公场所免费查阅。投资者对本报告书如有疑问，可拨打客服电话（95397）咨询本集合计划管理人。

太平洋证券股份有限公司

二〇二四年八月三十日