

太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资 基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 7 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| § 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 | 11 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 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内容的真实、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 | 14 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| § 7 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 39 |
| 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 | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 40 |
| 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 | 40 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 40 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 41 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 41 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 41 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 42 |
| 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 | 42 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 42 |
| § 10 重大事件揭示 | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 42 |
| 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 | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 43 |
| 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 | 43 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 43 |
| 10.8 其他重大事件 | 44 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 44 |
| 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 | 44 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 45 |
| § 12 备查文件目录 | 45 |
| 12.1 备查文件目录 | 45 |
| 12.2 存放地点 | 45 |
| 12.3 查阅方式 | 45 |

§ 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 | 8,000,017,491.93 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，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。</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 | 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%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|---------------------------|----------------------------|
| 名称 | 太平基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 赵霖 |
| | 联系电话 | 021-38556613 |
| | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn |
| 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 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 |

| | | |
|-------|------------|--------|
| | 太平金融大厦 7 楼 | 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》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.taipingfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 太平基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 156,815,830.98 |
| 本期利润 | 156,815,830.98 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0196 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.93% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.95% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 69,633,111.40 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0087 |
| 期末基金资产净值 | 8,069,650,603.33 |
| 期末基金份额净值 | 1.0087 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 6.98% |

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

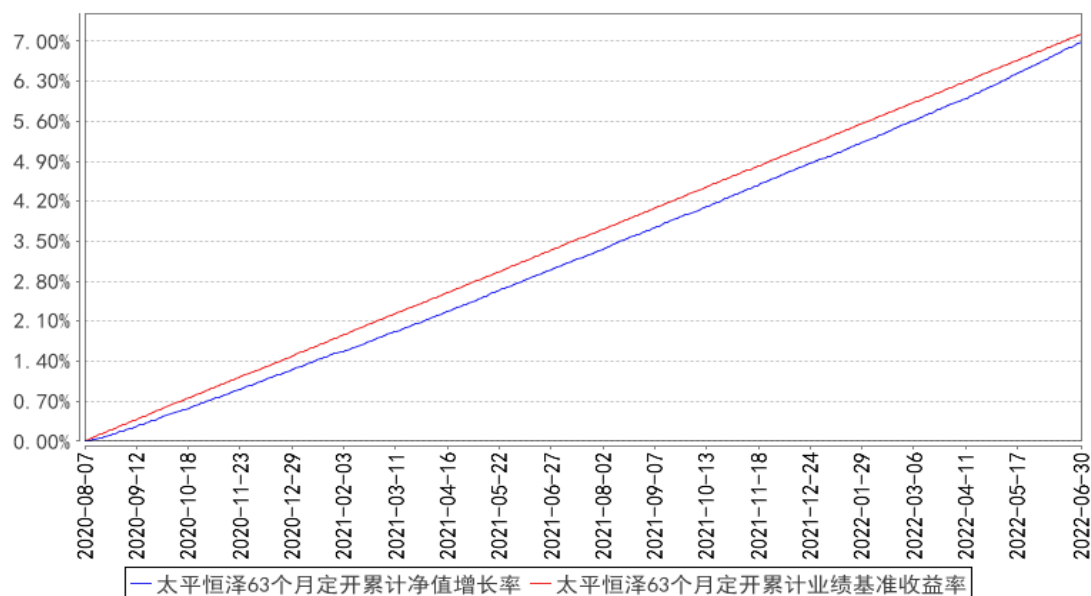
3.2 基金净值表现

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.35% | 0.01% | 0.31% | 0.01% | 0.04% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.02% | 0.01% | 0.93% | 0.01% | 0.09% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.95% | 0.01% | 1.86% | 0.01% | 0.09% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.83% | 0.01% | 3.75% | 0.01% | 0.08% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.98% | 0.01% | 7.12% | 0.01% | -0.14% | 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日为 2020 年 8 月 7 日，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 28 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金、太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金、太平恒利纯债债券型证券投资基金、太平睿盈混合型证券投资基金、太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金、太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金、太平恒睿纯债债券型证券投资基金、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金、太平智选一年定期开放股票型发起式证券投资基金、太平行业优选股票型证券投资基金、太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平睿安混合型证券投资基金、太平恒久纯债债券型证券投资基金、太平价值增长股票型证券投资基金、太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金、太平睿享混合型证券投资基金、太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平恒兴纯债债券型证券投资基金、太平睿庆混合型证券投资基金、太平中证 1000 指数增强型证券投资基金、太平安元债券型证券投资基金、太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-----------------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴超 | 本基金的基金经理、太平日日金货 | 2020 年 8 月 7 日 | - | 9 年 | 美国本特利商学院金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 5 月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公司担任部门经理、投资总监 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|---|
| | <p>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、太平睿享混合型证券投资基金基金经理</p> | | | | <p>等职。2017 年 3 月加入本公司。2018 年 2 月 12 日起任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2019 年 3 月 25 日担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 27 日起任太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 28 日起任太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 7 日起担任太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 12 日起担任太平恒久纯债债券型证券投资基金基金经理。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。</p> |
|--|---|--|--|--|---|

注：1、基金经理的任职日期、离任日期一般情况下根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；

若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员

员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年经济经历了持续的波动，第一季度经济开局良好，第二季度经济经受了新一轮疫情的影响，同时国外包括俄乌冲突、国外通胀大幅飙升、美联储加息缩表等等超预期的因素对国内经济和资本市场都造成一定的扰动。本报告期内，本基金主要以匹配封闭期限的利率债并加以杠杆增加收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 1.95%，同期业绩比较基准为 1.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，疫情防控逐渐取得成效，各地复工复产有序推进，同时此前受到影响的线下消费活动将明显修复。从高频数据来看，生产端的修复明显领先于需求端，随着供应链、物流以及

防疫政策的改善，预计三季度需求端也将环比改善。债券市场资金面持续保持宽松状态，收益率曲线基本保持平稳。后续需要关注各项政策的宽信用效果如何，从而决定经济增速修复的强度来确定债券收益率的空间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金资产的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值与产品委员会下设估值分委会，常任委员由稽核风控部、投资部门、研究部、基金运营部等部门负责人担任。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及《太平恒泽 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三次分红，一次分红方案为：每 10 份基金发放红利 0.21 元，二次分红方案为：每 10 份基金发放红利 0.1 元，三次分红方案为：每 10 份基金发放红利 0.1 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2022 上半年度，基金托管人在太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，

严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2022 上半年度，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、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人在本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

2022 上半年度，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中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 2,370,251.19 | 84,994,680.23 |
| 结算备付金 | | 39,784,578.96 | 52,862,302.26 |
| 存出保证金 | | 1,066.52 | 45,272.51 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | - | - |
| 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 | | - | - |
| 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 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | 14,803,358,955.33 | 14,462,512,585.49 |
| 其中：债券投资 | | 14,803,358,955.33 | 14,462,512,585.49 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 175,898,913.92 |
| 资产总计 | | 14,845,514,852.00 | 14,776,313,754.41 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021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 | | 6,772,173,128.36 | 6,448,262,874.29 |
| 应付清算款 | | 2,081,615.81 | 83,145,980.74 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 996,074.19 | 1,052,467.55 |
| 应付托管费 | | 332,024.71 | 350,822.53 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 281,405.60 | 2,505,968.17 |
| 负债合计 | | 6,775,864,248.67 | 6,535,318,113.28 |
| 净资产: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 8,000,017,491.93 | 8,000,016,747.46 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 69,633,111.40 | 240,978,893.67 |
| 净资产合计 | | 8,069,650,603.33 | 8,240,995,641.13 |
| 负债和净资产总计 | | 14,845,514,852.00 | 14,776,313,754.41 |

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0087 元，基金份额总额 8,000,017,491.93 份。

6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|-----|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | 238,237,872.13 | 190,077,767.49 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 1. 利息收入 | | 238,237,872.13 | 190,077,767.49 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 568,683.25 | 189,759.47 |
| 债券利息收入 | | 237,526,686.79 | 189,853,273.68 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 142,502.09 | 34,734.34 |
| 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 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 81,422,041.15 | 49,189,541.51 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 6,040,261.27 | 6,074,834.60 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 2,013,420.40 | 2,024,944.88 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 73,267,313.06 | 40,923,697.82 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 73,267,313.06 | 40,923,697.82 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | 2,111.38 | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 98,935.04 | 166,064.21 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 156,815,830.98 | 140,888,225.98 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 156,815,830.98 | 140,888,225.98 |

| | | | |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 156,815,830.98 | 140,888,225.98 |

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|------------------------------|---------------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 8,000,016,747.46 | - | 240,978,893.67 | 8,240,995,641.13 |
| 加：会计政策变更 | - | - | -160,924.31 | -160,924.31 |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 8,000,016,747.46 | - | 240,817,969.36 | 8,240,834,716.82 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 744.47 | - | -171,184,857.96 | -171,184,113.49 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 156,815,830.98 | 156,815,830.98 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以 | 744.47 | - | 6.99 | 751.46 |

| | | | | |
|--|---------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| “-”号填列) | | | | |
| 其中:1. 基金申购款 | 744.47 | - | 6.99 | 751.46 |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - | - |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | -328,000,695.93 | -328,000,695.93 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产(基金净值) | 8,000,017,491.93 | - | 69,633,111.40 | 8,069,650,603.33 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 8,000,016,404.20 | - | 101,551,049.15 | 8,101,567,453.35 |
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|------------------|---|----------------|------------------|
| 二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值) | 8,000,016,404.20 | - | 101,551,049.15 | 8,101,567,453.35 |
| 三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列) | 180.60 | - | 60,888,065.54 | 60,888,246.14 |
| (一)、 综 合 收 益 总 额 | - | - | 140,888,225.98 | 140,888,225.98 |
| (二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列) | 180.60 | - | 3.64 | 184.24 |
| 其中:1. 基 金 申 购 款 | 180.60 | - | 3.64 | 184.24 |
| 2 .基 金 赎 回 款 | - | - | - | - |
| (三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基 金 净 值 变 动(净 值 减 少 以 “-” 号 填 列) | - | - | -80,000,164.08 | -80,000,164.08 |
| (四)、 其 他 综 合 收 益 结 转 留 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-----------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 存收益 | | | | |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 8,000,016,584.80 | - | 162,439,114.69 | 8,162,455,699.49 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|------------|------------|
| <u>范宇</u> | <u>史彦刚</u> | <u>王瑞瑾</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平恒泽 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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告

>>》。

(a) 新金融工具准则

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

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

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

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

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

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和其他资产对应的账面价值分别为人民币 84,994,680.23 元、52,862,302.26 元、45,272.51 元、175,898,913.92 元和 14,462,512,585.49 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产对应的账面价值分别为人民币 84,999,017.52 元、

52,888,469.17 元、45,294.95 元和 14,638,220,048.46 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 6,448,262,874.29 元、83,145,980.74 元、1,052,467.55 元、350,822.53 元、66,908.58 元、2,277,059.59 元和 162,000.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 6,450,539,933.88 元、83,145,980.74 元、1,052,467.55 元、350,822.53 元和 228,908.58 元。

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

(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。将原金融工具减值准备期末金额调整为按照新金融工具准则的规定进行分类和计量的新损失准备的调节如下：

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则确认其他资产减值准备人民币 0.00 元，于 2022 年 1 月 1 日，持有到期类债券投资（原科目名称）重分类为债权投资，本基金按照新金融工具准则的要求对债权投资以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备，重新计量确认债权投资减值准备人民币 160,924.31 元，导致债权投资的账面价值及期初留存收益均减少人民币 160,924.31 元。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

2018 年 1 月 1 日(含)以后，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股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 2,370,251.19 |
| 等于：本金 | 2,368,661.39 |
| 加：应计利息 | 1,589.80 |
| 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 | 2,370,251.19 |

6.4.7.2 交易性金融资产

本基金于本期末未持有任何交易性金融资产。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/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

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2022年6月30日 | | | | |
|--------|-------|-------------------|----------------|----------------|------------|-------------------|
| | | 初始成本 | 利息调整 | 应计利息 | 减值准备 | 账面价值 |
| 债券 | 交易所市场 | 4,405,870,000.00 | -3,168,443.25 | 101,384,585.33 | 163,035.69 | 4,503,923,106.39 |
| | 银行间市场 | 10,165,000,000.00 | -62,618,457.91 | 197,054,306.85 | - | 10,299,435,848.94 |
| | 小计 | 14,570,870,000.00 | -65,786,901.16 | 298,438,892.18 | 163,035.69 | 14,803,358,955.33 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - | - |
| 合计 | | 14,570,870,000.00 | -65,786,901.16 | 298,438,892.18 | 163,035.69 | 14,803,358,955.33 |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 合计 |
|-----------|--------------|----------------------|----------------------|------------|
| | 未来12个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) | |
| 期初余额 | 160,924.31 | - | - | 160,924.31 |
| 本期从其他阶段转入 | - | - | - | - |
| 本期转出至其他 | - | - | - | - |

| | | | | |
|------|------------|---|---|------------|
| 阶段 | | | | |
| 本期新增 | 2,359.06 | - | - | 2,359.06 |
| 本期转回 | 247.68 | - | - | 247.68 |
| 其他变动 | - | - | - | - |
| 期末余额 | 163,035.69 | - | - | 163,035.69 |

注：“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。将原金融工具减值准备期末金额调整为按照新金融工具准则的规定进行分类和计量的新损失准备的调节如下：

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则确认其他资产减值准备人民币 0.00 元，于 2022 年 1 月 1 日，持有到期类债券投资（原科目名称）重分类为债权投资，本基金按照新金融工具准则的要求对债权投资以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备，重新计量确认债权投资减值准备人民币 160,924.31 元，导致债权投资的账面价值及期初留存收益均减少人民币 160,924.31 元。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 81,070.56 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 81,070.56 |
| 应付利息 | - |
| 预提信息披露费 | 179,507.37 |
| 预提审计费 | 20,827.67 |
| 合计 | 281,405.60 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|----|---------------------------------------|------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| | | |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 上年度末 | 8,000,016,747.46 | 8,000,016,747.46 |
| 本期申购 | 744.47 | 744.47 |
| 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 | 8,000,017,491.93 | 8,000,017,491.93 |

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。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期内未发生其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 本期期初 | 240,817,969.36 | - | 240,817,969.36 |
| 本期利润 | 156,815,830.98 | - | 156,815,830.98 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 6.99 | - | 6.99 |
| 其中：基金申购款 | 6.99 | - | 6.99 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -328,000,695.93 | - | -328,000,695.93 |
| 本期末 | 69,633,111.40 | - | 69,633,111.40 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 52,364.83 |
| 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 | 516,047.33 |

| | |
|----|------------|
| 其他 | 271.09 |
| 合计 | 568,683.25 |

6.4.7.14 股票投资收益

本基金在本报告期内无股票投资收益

6.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期末无债券投资收益。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金在本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金在本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

本基金在本报告期内无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

本基金在本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.21 其他收入

本基金在本报告期内无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 银行存款 | - |
| 买入返售金融资产 | - |
| 债权投资 | 2,111.38 |
| 其他债权投资 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 2,111.38 |

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 20,827.67 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |

| | |
|-------|-----------|
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 合计 | 98,935.04 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|-------------------|
| 太平基金管理有限公司（“太平基金”） | 基金管理人、基金销售机构、登记机构 |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”） | 基金托管人 |
| 太平人寿保险有限公司（“太平人寿”） | 基金管理人的股东 |

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,040,261.27 | 6,074,834.60 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 5.43 | 5.43 |

注：支付基金管理人太平基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,013,420.40 | 2,024,944.88 |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均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

基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|----------------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%) |
| 交通银行股份 有限公司 | 499,999,000.00 | 6.2500 | 499,999,000.00 | 6.2500 |
| 太平人寿保险 有限公司 | 999,999,000.00 | 12.5000 | - | - |

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 2022年1月1日至2022年6月30 日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|-------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行 | 2,370,251.19 | 52,364.83 | 10,453,991.45 | 69,790.33 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 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 | 2022 年1月 25日 | - | 2022 年1月 25日 | 0.2100 | 167,999,974.67 | 377.11 | 168,000,351.78 | - |
| 2 | 2022 年3月 28日 | - | 2022 年3月 28日 | 0.1000 | 79,999,984.90 | 186.29 | 80,000,171.19 | - |
| 3 | 2022 | - | 2022 | 0.1000 | 79,999,984.90 | 188.06 | 80,000,172.96 | - |

| | | | | | | | | |
|----|--------------|---|--------------|--------|----------------|--------|----------------|---|
| | 年 6 月 9 日 | | 年 6 月 9 日 | | | | | |
| 合计 | - | - | - | 0.4100 | 327,999,944.47 | 751.46 | 328,000,695.93 | - |

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末无因认购新发/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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 2,916,936,667.14 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 |
|--------|----------|----------------|--------|------------|------------------|
| 150314 | 15 进出 14 | 2022 年 7 月 1 日 | 104.59 | 5,370,000 | 561,670,430.32 |
| 200405 | 20 农发 05 | 2022 年 7 月 1 日 | 97.46 | 6,471,000 | 630,631,912.69 |
| 200405 | 20 农发 05 | 2022 年 7 月 4 日 | 97.46 | 7,448,000 | 725,845,539.44 |
| 200405 | 20 农发 05 | 2022 年 7 月 5 日 | 97.46 | 10,755,000 | 1,048,129,535.00 |
| 150314 | 15 进出 14 | 2022 年 7 月 7 日 | 104.59 | 1,053,000 | 110,137,609.52 |
| 合计 | | | | 31,097,000 | 3,076,415,026.97 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 3,855,236,461.22 元，于 2022 年 7 月 1 日、7 月 4 日、7 月 5 日、7 月 6 日、

7月7日、7月8日、7月11日、7月12日、7月13日、7月14日、7月15日、7月18日、7月20日、7月21日、7月22日、7月25日、7月26日、7月27日、7月28日、7月29日、8月1日、8月5日、8月8日、8月9日、8月10日、8月11日、8月12日、8月15日、8月16日、8月17日、8月18日、8月19日、8月22日、8月23日、8月26日、8月29日、8月30日、8月31日、9月1日、9月2日、9月8日、9月9日、9月13日、9月27日、9月28日、9月29日、9月30日、10月10日、10月11日、10月12日、10月13日、10月14日、10月17日、10月18日、10月19日、10月20日、10月21日、10月24日、10月25日、10月26日、10月27日、10月28日、11月3日、11月4日、11月7日、11月8日、11月9日、11月10日、11月11日、11月14日、11月15日、11月16日、11月17日、12月13日、12月14日、12月15日、12月19日、12月20日和12月21日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 310,467,569.99 | 303,566,833.34 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 14,492,891,385.34 | 14,158,945,752.15 |
| 合计 | 14,803,358,955.33 | 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。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 6,772,173,128.36 元将在六个月以内到期到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价

值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|---------------|-------------------|-------|-----|-------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 2,370,251.19 | - | - | - | 2,370,251.19 |
| 结算备付金 | 39,784,578.96 | - | - | - | 39,784,578.96 |
| 存出保证金 | 1,066.52 | - | - | - | 1,066.52 |
| 债权投资 | - | 14,803,358,955.33 | - | - | 14,803,358,955.33 |
| 资产总计 | 42,155,896.67 | 14,803,358,955.33 | - | - | 14,845,514,852.00 |
| 负债 | | | | | |

| | | | | | |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------|----------------|-------------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 996,074.19 | 996,074.19 |
| 应付托管费 | - | - | - | 332,024.71 | 332,024.71 |
| 应付清算款 | - | - | - | 2,081,615.81 | 2,081,615.81 |
| 卖出回购金融资产款 | 6,772,173,128.36 | - | - | - | 6,772,173,128.36 |
| 其他负债 | - | - | - | 281,405.60 | 281,405.60 |
| 负债总计 | 6,772,173,128.36 | - | - | 3,691,120.31 | 6,775,864,248.67 |
| 利率敏感度缺口 | -6,730,017,231.69 | 14,803,358,955.33 | - | -3,691,120.31 | 8,069,650,603.33 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 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 |
| 其他资产 | - | 14,462,512,585.49 | - | 175,898,913.92 | 14,638,411,499.41 |
| 资产总计 | 137,902,255.00 | 14,462,512,585.49 | - | 175,898,913.92 | 14,776,313,754.41 |
| 负债 | | | | | |
| 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 |
| 其他负债 | - | - | - | 2,505,968.17 | 2,505,968.17 |
| 负债总计 | 6,448,262,874.29 | - | - | 87,055,238.99 | 6,535,318,113.28 |
| 利率敏感度缺口 | -6,310,360,619.29 | 14,462,512,585.49 | - | 88,843,674.93 | 8,240,995,641.13 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

本基金本报告期末及上年度可比期间均未持有公允价值计量的金融工具。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括持有至到期投资、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债。于 2022 年 6 月 30 日，除以下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：

本基金持有的交易所市场债券账面价值人民币 4,503,923,106.39 元，公允价值人民币 4,567,639,132.73 元；银行间市场债券账面价值人民币 10,299,435,848.94 元，公允价值人民币 10,515,646,306.85 元；合计持有债券的账面价值人民币 14,803,358,955.33 元，公允价值人民币 15,083,285,439.58 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市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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本基金本报告期末,无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 14,803,358,955.33 | 99.72 |
| | 其中:债券 | 14,803,358,955.33 | 99.72 |
| | 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 | 42,154,830.15 | 0.28 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,066.52 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 14,845,514,852.00 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 506,089,729.20 | 6.27 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 13,411,368,728.78 | 166.20 |
| | 其中：政策性金融债 | 13,411,368,728.78 | 166.20 |
| 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 | 885,900,497.35 | 10.98 |
| 10 | 合计 | 14,803,358,955.33 | 183.44 |

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 | 200405 | 20 农发 05 | 36,700,000 | 3,576,601,946.48 | 44.32 |
| 2 | 150314 | 15 进出 14 | 26,750,000 | 2,797,892,739.48 | 34.67 |
| 3 | 018083 | 农发 2001 | 15,216,130 | 1,558,045,240.32 | 19.31 |
| 4 | 108904 | 农发 2102 | 14,280,730 | 1,456,269,947.88 | 18.05 |
| 5 | 200212 | 20 国开 12 | 10,100,000 | 1,041,496,476.34 | 12.91 |

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

本基金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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行、国家开发银行、中国农业发展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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 1,066.52 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,066.52 |

7.11.4 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的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在前十名股票中流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基 金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|------------------|----------------|-----------|----------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) | 持有份额 | 占总份额比 例 (%) |
| 302 | 26,490,124.15 | 7,999,994,000.00 | 99.9997 | 23,491.93 | 0.0003 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 2.10 | 0.0000 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 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 | 8,000,016,747.46 |
| 本报告期基金总申购份额 | 744.47 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 8,000,017,491.93 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况

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

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

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|------------------|-------------------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 天风证券 | 30,432,000.00 | 100.00 | 74,332,016,000.00 | 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 | 太平基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2022 年 01 月 21 日 |
| 2 | 太平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 | 2022 年 01 月 24 日 |
| 3 | 太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2021 年第四季度报告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2022 年 01 月 24 日 |
| 4 | 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 | 2022 年 03 月 25 日 |
| 5 | 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 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2022 年 03 月 30 日 |
| 6 | 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）（2022 年第 1 号） | 指定报刊、基金管理人网站 | 2022 年 04 月 20 日 |
| 7 | 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 | 2022 年 04 月 20 日 |
| 8 | 太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金 2022 年第一季度报告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2022 年 04 月 22 日 |
| 9 | 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 | 2022 年 06 月 08 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|-------------------------|------------------|------|------|------------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 20220101-20220630 | 1,999,999,000.00 | - | - | 1,999,999,000.00 | 24.9999 |
| 机构 | 2 | 20220101-20220630 | 2,499,999,000.00 | - | - | 2,499,999,000.00 | 31.2499 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时 | | | | | | | |

赎回持有的全部基金份额。

注：报告期末同一投资者通过多个基金账户持有本基金的合并计算。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平恒泽 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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日