

太平洋元债券型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 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 2024 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 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	10
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 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	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	43
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	43

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	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.11 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平洋元债券型证券投资基金	
基金简称	太平洋元债券	
基金主代码	015437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 5 月 5 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	98,821,173.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	太平洋元债券 A	太平洋元债券 C
下属分级基金的交易代码	015437	015449
报告期末下属分级基金的份额总额	98,811,567.38 份	9,605.86 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	<p>本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求将信用风险降到最低，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益。</p> <p>1、信用债券投资策略</p> <p>本基金将重点投资信用类债券，以提高组合收益能力。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，本基金将在信用评级的基础上和信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。</p> <p>2、收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化，相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略；其次，通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较，可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。</p> <p>3、放大策略</p> <p>放大操作即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。</p> <p>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、国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>6、可转换债券及可交换债券投资策略</p> <p>(1) 本基金投资于可转债，主要目标是发挥可转债“进可攻、退可守”的属性，一方面可转债具有债券的价值底线，能够降低基金净值的下行风险；另一方面，正股上涨会显著提升可转债的投资价值，为组合带来超额收益。(2) 本基金投资于可交换债，除参考上述可转债分析体系外，还将关注可交换债发行人与标的股票不同对于可交换债投资价值的影响，选择综合性价比突出的个券进行投资。</p> <p>7、股票投资策略</p> <p>本基金依托于基金管理人的投资研究平台，紧密跟踪中国经济结构转型的改革方向，努力探寻在调结构、促改革中具备长期价值增长潜力的上市公司。股票投资采用定量和定性分析相结合的策略。基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化，同时监控组合中证券的估值水平，在市场价格明显高于其内在合理价值时适时卖出证券。本基金可以投资港股通股票，将采用与 A 股市场相同的个股精选策略，从企业盈利能力，盈利的确定性、成长性、持续性等角度入手，精选未来 3-5 年存在良好的增值可能的投资标的。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。本基金可投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		太平基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	赵霖	方圆
	联系电话	021-38556613	95559
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn	fangy_20@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	中国（上海）自由贸易试验区银

	101 室	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	《证券时报》
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	太平安元债券 A	太平安元债券 C
本期已实现收益	1,302,545.83	143.75
本期利润	2,531,806.75	238.71
加权平均基金份额 本期利润	0.0235	0.0192
本期加权平均净 值利润率	2.34%	1.92%
本期基金份额净 值增长率	2.36%	2.26%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	207,601.02	-20.69
期末可供分配基 金份额利润	0.0021	-0.0022
期末基金资产净 值	100,583,005.28	9,736.51

期末基金份额净值	1.0179	1.0136
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.79%	1.36%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

太平洋元债券 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	-0.13%	0.10%	0.33%	0.07%	-0.46%	0.03%
过去三个月	1.28%	0.10%	1.26%	0.09%	0.02%	0.01%
过去六个月	2.36%	0.09%	2.61%	0.10%	-0.25%	-0.01%
过去一年	-0.54%	0.16%	2.21%	0.10%	-2.75%	0.06%
自基金合同生效起至今	1.79%	0.18%	3.46%	0.10%	-1.67%	0.08%

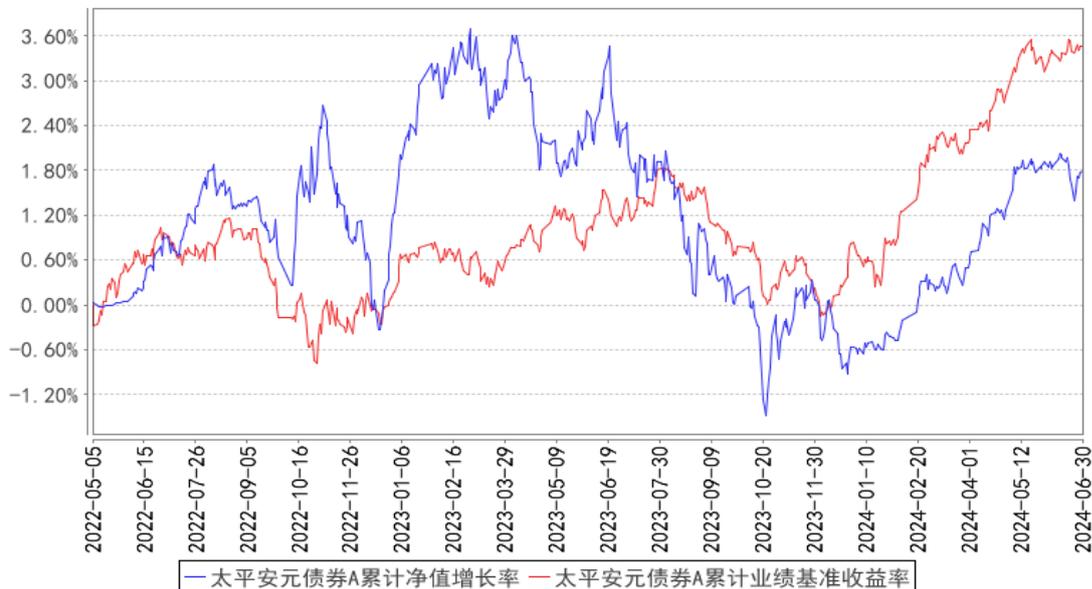
太平洋元债券 C

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	-0.14%	0.10%	0.33%	0.07%	-0.47%	0.03%
过去三个月	1.24%	0.10%	1.26%	0.09%	-0.02%	0.01%
过去六个月	2.26%	0.09%	2.61%	0.10%	-0.35%	-0.01%
过去一年	-0.72%	0.16%	2.21%	0.10%	-2.93%	0.06%
自基金合同生效起	1.36%	0.18%	3.46%	0.10%	-2.10%	0.08%

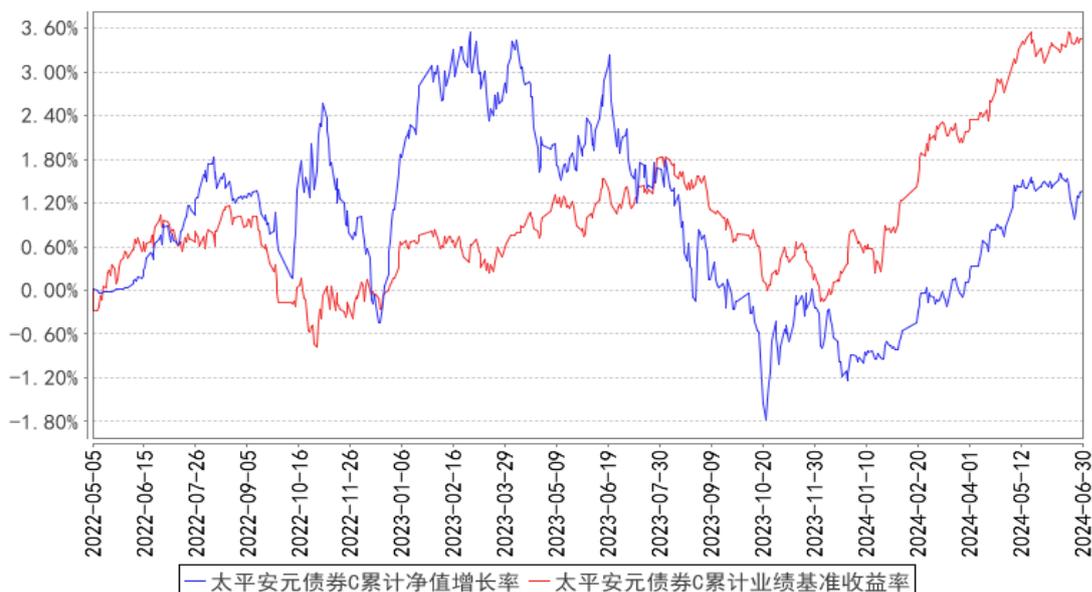
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

太平洋元债券A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



太平洋元债券C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 2022 年 5 月 05 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，2016 年 8 月 22 日更名为太平基金管理有限公司。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 39 只证券投资基金。

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		
苏大明	本基金的基金经理	2024 年 1 月 11 日	-	11 年	格罗宁根大学工商管理（金融）专业理学硕士，具有证券投资基金从业资格。2012 年起先后在大公国际资信评估有限公司、长江养老保险股份有限公司从事信用评估研究相关工作。2016 年 4 月加入本公司，从事投资研究及管理工作。2024 年 1 月 11 日起担任太平洋元债券型证券投资基金基金经理。
甘源	本基金的基金经理	2022 年 5 月 5 日	2024 年 1 月 11 日	9 年	清华大学金融硕士，具有证券投资基金从业资格。2015 年起先后在中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、恒大研究院从事资金运营、宏观研究及货币研究等工作。2019 年 11 月加入太平基金管理有限公司。2021 年 2 月 22 日至 2023 年 4 月 10 日担任太平日日金货币市场基金基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理。2021 年 11 月 18 日起担任太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 21 日起担任太平睿庆混合型证券投资基金基金经理。2022 年 5 月 5 日至 2024 年 1 月 11 日担任太平洋元债券型证券投资基金基金经理。2022 年

					6月27日至2023年7月13日担任太平嘉和三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2024年4月10日起担任太平中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。
陈晓	公司助理总经理、固定收益投资部总监、本基金的基金经理	2022年5月5日	-	14年	南开大学精算学专业经济学硕士。2010年7月加入光大保德信基金管理有限公司，历任投资部研究助理、固定收益研究员、固定收益高级研究员。2018年11月加入太平基金管理有限公司，现任公司助理总经理、固定收益投资部总监。2019年3月29日至2020年4月15日担任太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理。2019年3月29日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2020年9月17日起担任太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020年11月10日起担任太平睿安混合型证券投资基金基金经理。2021年4月22日至2024年6月24日担任太平丰盈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。2021年12月21日起担任太平睿庆混合型证券投资基金基金经理。2022年5月5日起担任太平洋元债券型证券投资基金基金经理。

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

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

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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非公平交易的情况。

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

2024 年上半年，中国资本市场经历了复杂的变化。债券市场在“弱复苏”和“宽货币”政策的影响下，整体表现较为强劲。A 股市场则呈现出明显的分化，上证指数一季度上涨 2.23%，二季度下跌 2.43%，而创业板一季度下跌 3.87%，二季度下跌 7.41%。市场对经济增长的预期出现波动，投资者对确定性资产给予溢价，同时要求对不确定性更高的风险补偿。

在权益市场方面，本基金采取了谨慎的投资策略，大部分时间保持低仓位状态，以减少市场波动对基金净值的影响。我们以大盘价值股为主，适时参与市场的短期反弹机会，确保在市场不确定性中稳健运作。

债券市场方面，本基金积极响应市场变化，通过增加长久期利率债的配置，抓住了收益率下行的机会，为基金带来了良好的收益。同时，对信用债组合进行了优化，提高了组合的静态收益。

转债市场作为实现多元化投资的重要工具，我们注意到转债估值处于较低水平，提供了投资机会。本基金选择了基本面稳健、估值合理的低价转债进行投资，并密切关注市场动态，适时调整投资策略。

展望未来，本基金将继续采取谨慎乐观的态度，坚持稳健型投资策略。在债券市场，我们将继续采用票息策略，把握长债交易机会，并密切跟踪市场趋势。在权益市场，我们将根据估值和宏观经济指标的变化，逐步增加权益仓位，同时关注确定性资产的过度交易风险。

通过多元化的资产配置和严格的风险管理，本基金力求在不确定的市场环境中为投资者实现稳定的收益。我们将继续努力，以专业的投资管理能力，为投资者创造长期价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平洋元债券 A 的份额净值增长率为 2.36%，同期业绩比较基准收益率为 2.61%；太平洋元债券 C 的份额净值增长率为 2.26%，同期业绩比较基准收益率为 2.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年上半年，宏观经济的缓慢复苏与新一轮科技浪潮和产业变革的双重影响，构成了当前经济形势的主要特征。实体经济的资产回报率持续低迷。但未来实际利率的下降为经济回暖提供了潜在动力。同时，科技创新的加速推进，如人工智能、5G 和大数据等前沿技术的应用，正在推动经济结构的优化升级。政策制定者和企业需要加大研发投入，推动技术创新和管理创新，以适应这一变革。海外市场的复杂性与降息预期，也对全球经济产生了连锁反应，增加了资本流动和投资格局的不确定性。

在债券市场，总需求的弱复苏和政策力度的稳健，预计将维持市场的震荡态势，仍有波段操作的机会。股票市场则反映出经济增长预期的低迷，企业盈利有望在二季度触底后逐步回升。国内流动性的持续宽松，为股票市场带来了结构性机会。然而，面对市场的不确定性，我们需要保持谨慎而乐观的态度，密切关注宏观经济和政策的动向，合理配置资产，以实现稳健的投资回报。

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，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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。公司管理层下设立估值委员会，常任委员由公司总经理、分管投资部门、研究部、运营部高管及稽核风控部、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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 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

本报告期内，基金托管人在太平洋元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洋元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洋元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：太平洋元债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	742,343.48	1,593,868.02
结算备付金		190,771.15	1,519,367.95
存出保证金		10,814.31	5,932.37
交易性金融资产	6.4.7.2	120,252,205.45	153,173,682.23
其中：股票投资		1,169,190.00	-
基金投资		-	-
债券投资		119,083,015.45	153,173,682.23
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	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		30,622.21	964,206.99
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		121,226,756.60	157,257,057.56
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6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		20,007,660.30	33,026,340.68
应付清算款		384,551.44	1,107,808.81
应付赎回款		10.17	-
应付管理人报酬		32,992.20	41,786.51
应付托管费		8,248.05	10,446.61
应付销售服务费		1.50	3.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		784.84	20.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	199,766.31	277,715.16
负债合计		20,634,014.81	34,464,121.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	98,821,173.24	123,480,604.08
未分配利润	6.4.7.11	1,771,568.55	-687,668.50
净资产合计		100,592,741.79	122,792,935.58
负债和净资产总计		121,226,756.60	157,257,057.56

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 98,821,173.24 份，其中 A 类基金份额净值 1.0179 元，A 类基金份额 98,811,567.38 份；C 类基金份额净值 1.0136 元，C 类基金份额 9,605.86 份。

6.2 利润表

会计主体：太平洋元债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,233,803.75	2,345,866.65
1. 利息收入		14,911.77	24,271.64
其中：存款利息收入	6.4.7.12	12,595.78	7,856.25
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		2,315.99	16,415.39
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,989,536.10	2,678,103.79
其中：股票投资收益	6.4.7.13	-242,629.37	244,934.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	2,217,084.37	2,289,147.64
资产支持证券投资	6.4.7.15	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	15,081.10	144,021.44
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,229,355.88	-356,508.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
减：二、营业总支出		701,758.29	871,772.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	216,116.41	270,316.11
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	54,029.15	67,579.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11.97	9,419.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		339,474.60	432,466.04
其中：卖出回购金融资产支出		339,474.60	432,466.04
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		427.68	0.02
8. 其他费用	6.4.7.22	91,698.48	91,991.88

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,532,045.46	1,474,093.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,532,045.46	1,474,093.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,532,045.46	1,474,093.76

6.3 净资产变动表

会计主体：太平安元债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	123,480,604.08	-	-687,668.50	122,792,935.58
二、本期期初净资产	123,480,604.08	-	-687,668.50	122,792,935.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,659,430.84	-	2,459,237.05	-22,200,193.79
（一）、综合收益总额	-	-	2,532,045.46	2,532,045.46
（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）	-24,659,430.84	-	-72,808.41	-24,732,239.25
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-24,659,430.84	-	-72,808.41	-24,732,239.25
（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	98,821,173.24	-	1,771,568.55	100,592,741.79
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	141,703,145.43	-	1,719,055.16	143,422,200.59
二、本期期初净资产	141,703,145.43	-	1,719,055.16	143,422,200.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,215,951.27	-	1,165,807.68	-17,050,143.59
(一)、综合收益总额	-	-	1,474,093.76	1,474,093.76
(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)	-18,215,951.27	-	-308,286.08	-18,524,237.35
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-18,215,951.27	-	-308,286.08	-18,524,237.35
(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	123,487,194.16	-	2,884,862.84	126,372,057.00

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：

曹琦

邓先虎

王瑞瑾

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

太平洋元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[2022]444号《关于准予太平洋元债券型证券投资基金注册的批复》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《太平洋元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 303,277,101.32 元，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）予以验证。经向中国证监会备案，《太平安元债券型证券投资基金基金合同》于 2022 年 5 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 303,288,276.61 份，其中认购资金利息折合 11,175.29 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《太平安元债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费用、申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平安元债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通股票”）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、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、政府机构债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金股票投资占基金资产的比例为 0-20%（其中港股通股票投资比例不得超过股票资产的 50%）；本基金投资可转换债券和可交换债券合计不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+中证港股通综合指数人民币收益率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

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。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

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 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	742,343.48
等于：本金	741,981.47
加：应计利息	362.01
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	742,343.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,208,389.00	-	1,169,190.00	-39,199.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	36,735,078.84	371,645.45	37,172,778.45	66,054.16
	银行间市场	79,221,314.37	1,383,037.00	81,910,237.00	1,305,885.63
	合计	115,956,393.21	1,754,682.45	119,083,015.45	1,371,939.79
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	117,164,782.21	1,754,682.45	120,252,205.45	1,332,740.79	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有任何期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有任何黄金衍生品。

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

本基金本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末未计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	6,667.83

其中：交易所市场	1,345.03
银行间市场	5,322.80
应付利息	-
预提信息披露费	179,672.34
预提审计费	13,426.14
合计	199,766.31

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

太平安元债券 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,458,855.57	123,458,855.57
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-24,647,288.19	-24,647,288.19
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	98,811,567.38	98,811,567.38

太平安元债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,748.51	21,748.51
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-12,142.65	-12,142.65
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	9,605.86	9,605.86

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 未分配利润

单位：人民币元

太平安元债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,270,536.77	583,060.46	-687,476.31
本期期初	-1,270,536.77	583,060.46	-687,476.31
本期利润	1,302,545.83	1,229,260.92	2,531,806.75
本期基金份额交易产生的变动数	175,591.96	-248,484.50	-72,892.54

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	175,591.96	-248,484.50	-72,892.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	207,601.02	1,563,836.88	1,771,437.90

太平安元债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-294.31	102.12	-192.19
本期期初	-294.31	102.12	-192.19
本期利润	143.75	94.96	238.71
本期基金份额交易产生的变动数	129.87	-45.74	84.13
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	129.87	-45.74	84.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20.69	151.34	130.65

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	9,792.49
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	2,711.27
其他	92.02
合计	12,595.78

6.4.7.13 股票投资收益

6.4.7.13.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-242,629.37
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-242,629.37

6.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	4,004,903.22

减：卖出股票成本总额	4,243,114.60
减：交易费用	4,417.99
买卖股票差价收入	-242,629.37

6.4.7.13.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,701,228.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	515,855.38
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	2,217,084.37

6.4.7.14.2 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1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	162,260,533.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	160,592,595.83
减：应计利息总额	1,145,264.25
减：交易费用	6,817.59
买卖债券差价收入	515,855.38

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

6.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益申购差价收入。

6.4.7.16 贵金属投资收益

6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益赎回差价收入。

6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益申购差价收入。

6.4.7.17 衍生工具收益

6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益其他投资收益。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	15,081.10
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,081.10

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	1,229,355.88
股票投资	-39,199.00
债券投资	1,268,554.88
资产支持证券投资	-

基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1, 229, 355. 88

6. 4. 7. 20 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6. 4. 7. 21 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6. 4. 7. 22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	13, 426. 14
信息披露费	59, 672. 34
证券出借违约金	-
账户维护费	18, 600. 00
合计	91, 698. 48

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

截至本财务报告报出日，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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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、基金销售机构
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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	216,116.41	270,316.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	999.08	4,715.30
应支付基金管理人的净管理费	215,117.33	265,600.81

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 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.4% / 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1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	54,029.15	67,579.08

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 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期
-------------	----

方名称	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平洋元债券 A	太平洋元债券 C	合计
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平洋元债券 A	太平洋元债券 C	合计
太平基金	-	7,779.58	7,779.58
交通银行	-	1,611.49	1,611.49
合计	-	9,391.07	9,391.07

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给太平基金，再由太平基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.20% / 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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

太平洋元债券 A

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
太平人寿	98,735,189.57	99.9227	98,735,189.57	79.9742

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	742,343.48	9,792.49	1,565,895.60	4,089.82

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。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

太平安元债券 A								
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					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-
太平安元债券 C								
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					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2024 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

本基金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

本基金本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 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 20,007,660.30 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
2128028	21 邮储银行二级 01	2024 年 7 月 2 日	105.77	51,000	5,394,447.81
2128036	21 平安银行二级	2024 年 7 月 2 日	105.89	80,000	8,471,142.30
2228006	22 中国银行二级 01	2024 年 7 月 2 日	104.25	80,000	8,339,960.66
合计				211,000	22,205,550.77

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 年 6 月 30 日，本基金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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	6,255,783.67	6,565,289.04
合计	6,255,783.67	6,565,289.04

注：短期未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 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	上年度末
--------	-----	------

	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
AAA	90,818,572.84	116,820,086.56
AAA 以下	11,598,172.60	8,971,679.05
未评级	10,410,486.34	20,816,627.58
合计	112,827,231.78	146,608,393.19

注：长期未评级债券为国债、政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有人民币 20,007,660.30 元将在一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，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 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%。

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 2024 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有货币资金、结算备用金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 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	742,343.48	-	-	-	742,343.48
结算备付金	190,771.15	-	-	-	190,771.15
存出保证金	10,814.31	-	-	-	10,814.31
交易性金融资产	9,412,649.39	54,699,368.19	54,970,997.87	1,169,190.00	120,252,205.45
应收清算款	-	-	-	30,622.21	30,622.21
资产总计	10,356,578.33	54,699,368.19	54,970,997.87	1,199,812.21	121,226,756.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	10.17	10.17
应付管理人报酬	-	-	-	32,992.20	32,992.20
应付托管费	-	-	-	8,248.05	8,248.05
应付清算款	-	-	-	384,551.44	384,551.44
卖出回购金融资产款	20,007,660.30	-	-	-	20,007,660.30
应付销售服务费	-	-	-	1.50	1.50
应交税费	-	-	-	784.84	784.84
其他负债	-	-	-	199,766.31	199,766.31
负债总计	20,007,660.30	-	-	626,354.51	20,634,014.81
利率敏感度缺口	-9,651,081.97	54,699,368.19	54,970,997.87	573,457.70	100,592,741.79
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					
货币资金	1,593,868.02	-	-	-	1,593,868.02
结算备付金	1,519,367.95	-	-	-	1,519,367.95
存出保证金	5,932.37	-	-	-	5,932.37
交易性金融资产	37,590,420.31	103,770,246.78	11,813,015.14	-	153,173,682.23
应收清算款	-	-	-	964,206.99	964,206.99
资产总计	40,709,588.65	103,770,246.78	11,813,015.14	964,206.99	157,257,057.56
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	41,786.51	41,786.51
应付托管费	-	-	-	10,446.61	10,446.61
应付清算款	-	-	-	1,107,808.81	1,107,808.81
卖出回购金融资产款	33,026,340.68	-	-	-	33,026,340.68
应付销售服务费	-	-	-	3.72	3.72
应交税费	-	-	-	20.49	20.49
其他负债	-	-	-	277,715.16	277,715.16
负债总计	33,026,340.68	-	-	1,437,781.30	34,464,121.98
利率敏感度缺口	7,683,247.97	103,770,246.78	11,813,015.14	-473,574.31	122,792,935.58

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况
----	-----------------------------

	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
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 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	55,627.97	1,867,658.77
	2. 市场利率上升 25 个基点	-55,044.16	-1,812,902.88

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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-20%；此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,169,190.00	1.16	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,169,190.00	1.16	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.16% (2023 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性权益类投资)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	15,668,529.11	11,564,885.79

第二层次	104,583,676.34	141,608,796.44
第三层次	-	-
合计	120,252,205.45	153,173,682.23

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和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，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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基金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	1,169,190.00	0.96
	其中：股票	1,169,190.00	0.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	119,083,015.45	98.23
	其中：债券	119,083,015.45	98.23
	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	933,114.63	0.77

8	其他各项资产	41,436.52	0.03
9	合计	121,226,756.60	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	175,700.00	0.17
C	制造业	433,360.00	0.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	268,750.00	0.27
J	金融业	291,380.00	0.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,169,190.00	1.16

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600941	中国移动	2,500	268,750.00	0.27
2	601009	南京银行	20,000	207,800.00	0.21
3	601899	紫金矿业	10,000	175,700.00	0.17
4	688169	石头科技	400	157,040.00	0.16
5	002050	三花智控	8,000	152,640.00	0.15
6	605183	确成股份	8,000	123,680.00	0.12

7	601601	中国太保	3,000	83,580.00	0.08
---	--------	------	-------	-----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002920	德赛西威	633,966.00	0.52
2	002315	焦点科技	572,259.00	0.47
3	688213	思特威	337,153.10	0.27
4	688111	金山办公	280,094.22	0.23
5	600941	中国移动	253,975.00	0.21
6	688157	松井股份	232,980.00	0.19
7	000625	长安汽车	219,900.00	0.18
8	600079	人福医药	202,558.00	0.16
9	601009	南京银行	202,300.00	0.16
10	603596	伯特利	184,222.00	0.15
11	603197	保隆科技	179,580.00	0.15
12	688169	石头科技	178,618.00	0.15
13	601899	紫金矿业	178,590.00	0.15
14	002050	三花智控	174,010.00	0.14
15	002929	润建股份	162,644.00	0.13
16	601601	中国太保	156,812.00	0.13
17	300124	汇川技术	155,310.00	0.13
18	600498	烽火通信	154,625.00	0.13
19	605183	确成股份	142,490.00	0.12
20	003020	立方制药	123,860.00	0.10

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002920	德赛西威	584,392.00	0.48
2	002315	焦点科技	512,369.00	0.42
3	688213	思特威	350,147.00	0.29
4	688111	金山办公	265,347.50	0.22
5	688157	松井股份	229,118.12	0.19
6	600079	人福医药	192,600.00	0.16
7	000625	长安汽车	188,860.00	0.15
8	603596	伯特利	179,923.60	0.15
9	603197	保隆科技	177,575.00	0.14
10	002929	润建股份	149,990.00	0.12
11	600498	烽火通信	141,450.00	0.12

12	300124	汇川技术	129,569.00	0.11
13	603486	科沃斯	121,054.00	0.10
14	003020	立方制药	117,900.00	0.10
15	301000	肇民科技	115,640.00	0.09
16	002937	兴瑞科技	107,500.00	0.09
17	600346	恒力石化	103,246.00	0.08
18	601689	拓普集团	94,474.00	0.08
19	688777	中控技术	93,280.00	0.08
20	601601	中国太保	83,490.00	0.07

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,451,503.60
卖出股票收入（成交）总额	4,004,903.22

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,255,783.67	6.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,090,598.68	89.56
	其中：政策性金融债	10,410,486.34	10.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	8,237,293.99	8.19
7	可转债（可交换债）	14,499,339.11	14.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	119,083,015.45	118.38

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	230305	23 进出 05	100,000	10,410,486.34	10.35
2	2028034	20 浦发银行二级 03	80,000	8,480,640.00	8.43
3	2128036	21 平安银行二级	80,000	8,471,142.30	8.42
4	2028041	20 工商银行二级 01	80,000	8,468,602.74	8.42

5	2128028	21 邮储银行二级 01	80,000	8,461,878.91	8.41
---	---------	--------------	--------	--------------	------

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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，平安银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。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

本基金不投资股票。

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	10,814.31
2	应收清算款	30,622.21
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	41,436.52

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113056	重银转债	976,132.60	0.97
2	113052	兴业转债	865,741.37	0.86
3	113065	齐鲁转债	706,785.22	0.70
4	127100	神码转债	695,257.48	0.69
5	113064	东材转债	674,692.60	0.67
6	113641	华友转债	659,535.59	0.66
7	118024	冠宇转债	657,923.84	0.65
8	127045	牧原转债	622,517.54	0.62
9	113675	新 23 转债	579,665.21	0.58
10	123113	仙乐转债	550,000.00	0.55
11	110077	洪城转债	505,850.43	0.50
12	128144	利民转债	491,786.99	0.49
13	113640	苏利转债	471,168.04	0.47
14	123104	卫宁转债	459,127.12	0.46
15	113638	台 21 转债	448,373.15	0.45
16	113045	环旭转债	356,367.21	0.35
17	110062	烽火转债	352,507.32	0.35
18	123158	宙邦转债	341,143.97	0.34
19	127016	鲁泰转债	339,772.36	0.34
20	128083	新北转债	337,178.96	0.34
21	123146	中环转 2	327,049.59	0.33
22	118043	福立转债	323,873.54	0.32
23	113606	荣泰转债	309,753.69	0.31
24	118032	建龙转债	299,718.08	0.30
25	113623	凤 21 转债	247,692.33	0.25
26	111003	聚合转债	240,868.49	0.24
27	123059	银信转债	236,287.95	0.23
28	111007	永和转债	232,216.44	0.23
29	127074	麦米转 2	227,821.45	0.23
30	123211	阳谷转债	221,505.81	0.22
31	111010	立昂转债	221,341.92	0.22
32	123236	家联转债	177,395.59	0.18
33	123063	大禹转债	168,185.22	0.17
34	127085	韵达转债	110,101.01	0.11
35	123170	南电转债	64,001.00	0.06

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未有流通受限情况。

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

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 (%)
太平安元债券 A	172	574,485.86	98,735,189.57	99.9227	76,377.81	0.0773
太平安元债券 C	46	208.82	0.00	0.0000	9,605.86	100.0000
合计	216	457,505.43	98,735,189.57	99.9130	85,983.67	0.0870

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	太平安元债券 A	10,101.46	0.0102
	太平安元债券 C	1.00	0.0104
	合计	10,102.46	0.0102

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

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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	太平安元债券 A	太平安元债券 C
基金合同生效日 (2022 年 5 月 5 日) 基金份额总额	10,827,643.73	292,460,632.88

本报告期期初基金份额总额	123,458,855.57	21,748.51
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	24,647,288.19	12,142.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	98,811,567.38	9,605.86

§ 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未改变。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本公司及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	9,456,406.82	100.00	1,809.58	100.00	-

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) 公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定。最近一年未出现亏损或审计机构无法出具无保留意见的审计报告等情形；

(2) 经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到监管部门处罚；

(3) 合规风控能力较强。内部管理规范、严格，具备健全的内控和风控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。最近一年证监会对证券公司分类结果为 BB 类以上（含）；

(4) 交易服务能力较强。具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要。重点参考最近一个年度券商交易量市场排名；

(5) 研究服务能力较强。设置固定的研究机构，拥有专业的研究人员，能够及时全面地提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他信息服务等。

(6) 与公司签订综合服务协议。

基金管理人的总经理办公会根据上述标准确定可以合作的券商名单，由投资决策委员会在上述名单内确定租用的交易单元，并签订交易单元租用协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

报告期内未新增交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
天风证券	141,532,564.79	100.00	194,570,000.00	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	太平洋元债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 13 日
2	太平洋元债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 16 日
3	太平基金管理有限公司太平洋元债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 16 日
4	太平洋元债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 16 日
5	太平洋元债券型证券投资基金 2023 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
6	太平洋元债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 30 日
7	太平洋元债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 20 日
8	太平洋元债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 2 号）	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 20 日
9	太平洋元债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 20 日
10	太平洋元债券型证券投资基金 2024 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
11	太平洋元债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 28 日
12	太平洋元债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 28 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	20240101—20240630	98,735,189.57	-	-	98,735,189.57	99.9130
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。							

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、《太平安元债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平安元债券型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平安元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，503A）

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

2024 年 8 月 30 日