# 太平睿盈混合型证券投资基金
# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

# §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 太平睿盈混合 |
| 基金主代码 | 006973 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 3 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 191,728,424.58 份 |
| 投资目标 | 追求在严格控制风险的前提下，通过资产配置和灵活运用多种投资策略，争取高于业绩收益比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略<br>本基金采取主动投资管理的投资模式。在深入研究国内外的宏观经济走势，跟踪资产市场环境变化，通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略，将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。其中，当权益市场资产价格明显上涨时，适当增加权益类资产配置比例；当权益市场处于下行周期且市场风险偏好下降时，适当增加固定收益类资产配置比例，并通过灵活运用衍生品合约的套期保值与对冲功能，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。<br>2、债券投资策略<br>本管理人将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对资产组合进行积 |

| | |
|---|---|
| | 极管理。<br>3、股票投资策略<br>本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资思路，精选优质价值型股票进行重点投资。<br>（1）行业配置策略<br>本基金的行业配置，将根据宏观经济形势、国家政策变化、各行业景气差异以及市场风险偏好等因素的变化，结合历史经验总结，对行业配置不断进行调整和优化。<br>（2）个股精选策略<br>研究员对上市公司进行深入分析和紧密调研，精选行业景气向上、拥有显著竞争优势且估值存在提升空间的优质公司。本基金将选择合适时机，对此类优质公司进行投资。<br>4、股指期货投资策略<br>本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时，为避免市场冲击，提前建立股指期货多头头寸，然后逐步买入现货并解除股指期货多头，当完成现货建仓后将股指期货平仓；空头套期保值指当基金需要卖出现货时，先建立股指期货空头头寸，然后逐步卖出现货并解除股指期货空头，当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中，将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性，精细化确定投资方案比例。<br>5、国债期货投资策略<br>本基金以提高对利率风险管理能力，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与国债期货投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析；构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。<br>6、资产支持证券投资策略<br>本基金通过考量宏观经济走势、支持资产所在行业景气情况、资产池结构、提前偿还率、违约率、市场利率等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。 |

| | | |
|---|---|---|
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×80%＋沪深 300 指数收益率×20% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 太平基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 太平睿盈混合 A | 太平睿盈混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 006973 | 007669 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 159,705,852.67 份 | 32,022,571.91 份 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日） | |
|---|---|---|
| | 太平睿盈混合 A | 太平睿盈混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -3,357,226.89 | -703,885.64 |
| 2.本期利润 | -23,638,168.52 | -7,844,690.75 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1480 | -0.1766 |
| 4.期末基金资产净值 | 204,218,569.14 | 39,432,475.20 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2787 | 1.2314 |

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、所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

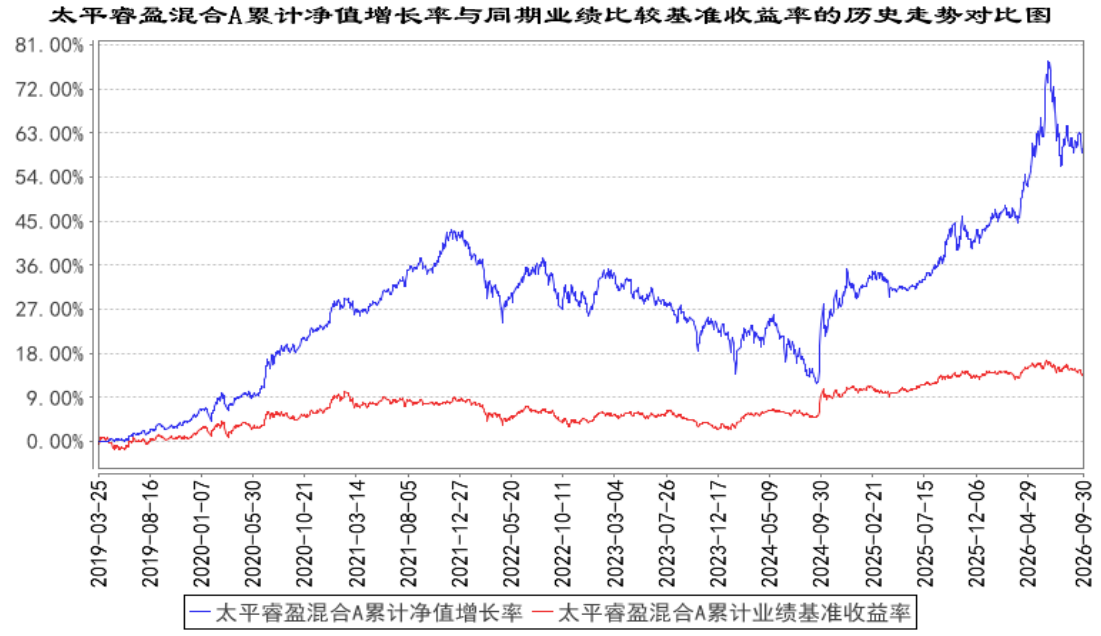
太平睿盈混合 A

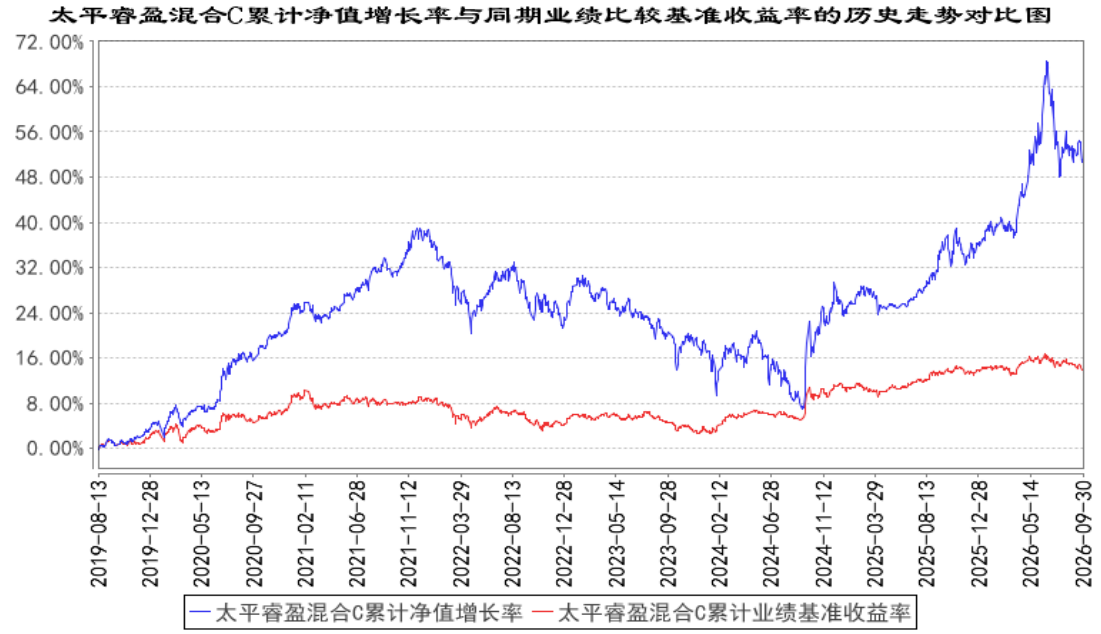
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -10.36% | 0.99% | -2.14% | 0.26% | -8.22% | 0.73% |
| 过去六个月 | 10.06% | 0.97% | 0.66% | 0.26% | 9.40% | 0.71% |
| 过去一年 | 10.44% | 0.82% | 0.17% | 0.23% | 10.27% | 0.59% |
| 过去三年 | 27.03% | 0.71% | 8.90% | 0.22% | 18.13% | 0.49% |
| 过去五年 | 17.98% | 0.64% | 5.47% | 0.22% | 12.51% | 0.42% |
| 过去七年 | 55.30% | 0.58% | 13.31% | 0.23% | 41.99% | 0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | 59.13% | 0.56% | 13.70% | 0.23% | 45.43% | 0.33% |

太平睿盈混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -10.47% | 0.99% | -2.14% | 0.26% | -8.33% | 0.73% |
| 过去六个月 | 9.79% | 0.97% | 0.66% | 0.26% | 9.13% | 0.71% |
| 过去一年 | 9.90% | 0.82% | 0.17% | 0.23% | 9.73% | 0.59% |
| 过去三年 | 25.13% | 0.71% | 8.90% | 0.22% | 16.23% | 0.49% |
| 过去五年 | 15.06% | 0.64% | 5.47% | 0.22% | 9.59% | 0.42% |
| 过去七年 | 49.95% | 0.58% | 13.31% | 0.23% | 36.64% | 0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | 50.70% | 0.57% | 13.86% | 0.23% | 36.84% | 0.34% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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






注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 03 月 25 日，本基金的建仓期为 6 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。

2、本基金自 2019 年 08 月 13 日起增加 C 类基金份额。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 邵闯 | 本基金的基金经理 | 2025 年 9 月 8 日 | - | 9 年 | 上海交通大学工程硕士，具有证券投资基金从业资格。2017 年 4 月起在光大证券股份有限公司研究所从事研究分析工作。2020 年 3 月加入本公司。2024 年 1 月 11 日至 2025 年 4 月 29 日担任太平睿安混合型证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 8 日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。 |
| 史彦刚 | 公司助理总经理、本基金的基金经理 | 2025 年 9 月 12 日 | - | 19 年 | 中国人民大学经济学硕士。曾就职于中国工商银行、中国银行业监督管理委员会、中信银行，2007 年 9 月起先后任嘉实基金管理有限公司信用分析师、国泰基金管理有限公司投资经理、长城基金管理有限公司基金经理、格林基金管理有限公司副总经理等职务。2020 年 4 月加入太平基金管理有限公司，现任公司助理总经理。2023 年 6 月 2 日起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。2025 年 9 月 12 日起担任太平安元债券型证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 12 日起担任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。2025 年 9 月 12 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。2025 年 9 月 12 日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2026 年 6 月 16 日起担任太平嘉信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遵规守信情况的说明

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，不存在违法违规或未履行基金合同的情形。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及有关法规，建立公司内部的公平交易管理制度体系，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，以确保公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，防范不公平交易和利益输送行为。

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相关制度的有关规定，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，海外地缘博弈持续，主要经济体货币政策路径分歧加大。国内 AI 产业链与库存周期带动内需结构性复苏，地产仍处于筑底阶段，制造业投资结构优化，经济总体平稳，但物价分化与内需不确定性仍存。货币政策延续适度宽松基调，但总量工具保持定力，以结构性精准调控为主。9 月末国常会部署加大逆周期调节，推出增量政策。财政端加速政府债发行并用好债务结存限额稳定投资，协同央行推出房贷贴息与 PSL 降息扩围，结构性工具精准支持科创、基建与民企。

权益市场延续结构性分化，风险偏好收敛，轮动加快、波动放大。前期强势的科创领域调整相对较多，创业板指创单季度最大跌幅；煤炭、石油石化等防御板块逆势上涨。债市在经济弱修复与资金面合理充裕下震荡下行，曲线平坦化，5 年期信用债受摊余债基配置需求影响下行到前期低位。可转债估值性价比下降，存量收缩，个券分化加剧。

本基金股票仓位保持在 20-30%，聚焦科技成长，精选估值相对合理、业绩确定性强、成长空间大的科技股进行配置，在聚焦 AI 算力、国产算力的同时，7 月份进行了一定的组合再平衡调整，降低了行业集中度，阶段性配置了电力、医药行业。债券以 3 年信用债为底仓，通过长期国债换券轮动、久期波段操作，有效提升组合资本利得。

展望四季度，随着财政政策逐步显效，国内经济内生动能有望修复，国内外 AI 产业升级趋势不改，但是产业资本开支压力、需求端收入兑现程度的可见性相对下降。在逆全球化、主要国家加息背景下，需关注海外地缘政治局势变化和加息节奏。权益市场结构轮动加快，市场投资难度有所增加，我们将在继续保持科技成长特征的同时，精选个股，密切关注算力行业二阶增速变化的情况和业绩可见度，对标基准适当均衡组合配置，通过量化方式进行一定的动态调整。债市或延续震荡，我们将坚持信用底仓、中性久期、波段灵活的操作思路。适当增加可转债配置，在严控估值基础上，寻找溢价率回归和基本面向上的长线配置机会。本基金将秉持稳健理念，努力为持有人创造长期可持续回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平睿盈混合 A 份额净值增长率为-10.36%，同期业绩比较基准收益率为-2.14%；太平睿盈混合 C 份额净值增长率为-10.47%，同期业绩比较基准收益率为-2.14%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 60,987,202.00 | 24.49 |
| | 其中：股票 | 60,987,202.00 | 24.49 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 182,775,495.65 | 73.39 |
| | 其中：债券 | 182,775,495.65 | 73.39 |
| | 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 | 2,499,599.37 | 1.00 |
| | 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 | 2,729,313.24 | 1.10 |
| 8 | 其他资产 | 45,926.93 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 249,037,537.19 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 4,504,971.00 | 1.85 |
| C | 制造业 | 44,389,182.28 | 18.22 |
| 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 | 3,396,992.72 | 1.39 |
| J | 金融业 | 5,617,000.00 | 2.31 |
| 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 | 3,079,056.00 | 1.26 |
| 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 | 60,987,202.00 | 25.03 |

### 5.2.2 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 688498 | 源杰科技 | 3,380 | 5,451,940.00 | 2.24 |
| 2 | 002463 | 沪电股份 | 31,000 | 3,593,830.00 | 1.47 |
| 3 | 688766 | 普冉股份 | 9,851 | 3,513,260.64 | 1.44 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 104,900 | 3,124,971.00 | 1.28 |
| 5 | 603259 | 药明康德 | 18,400 | 3,079,056.00 | 1.26 |
| 6 | 600183 | 生益科技 | 23,300 | 3,028,068.00 | 1.24 |
| 7 | 601108 | 财通证券 | 340,000 | 2,771,000.00 | 1.14 |
| 8 | 300394 | 天孚通信 | 10,140 | 2,644,207.80 | 1.09 |
| 9 | 688256 | 寒武纪 | 2,572 | 2,595,173.72 | 1.07 |
| 10 | 300308 | 中际旭创 | 3,200 | 2,587,008.00 | 1.06 |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 80,512,360.32 | 33.04 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 21,258,919.89 | 8.73 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 60,123,752.57 | 24.68 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 20,654,452.60 | 8.48 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 226,010.27 | 0.09 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 182,775,495.65 | 75.02 |

## 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 269951 | 26 贴现国债 51 | 300,000 | 29,862,184.62 | 12.26 |
| 2 | 2600006 | 26超长特别国债06 | 200,000 | 20,230,663.04 | 8.30 |
| 3 | 260019 | 26 附息国债 19 | 200,000 | 19,989,063.01 | 8.20 |
| 4 | 243967 | 25 安租 16 | 160,000 | 16,245,677.59 | 6.67 |
| 5 | 244195 | 25 唐租 04 | 150,000 | 15,261,777.53 | 6.26 |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时，为避免市场冲击，提前建立股指期货多头头寸，然后逐步买入现货并解除股指期货多头，当完成现货建仓后将股指期货平仓；空头套期保值指当基金需要卖出现货时，先建立股指期货空头头寸，然后逐步卖出现货并解除股指期货空头，当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中，将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性，精细化确定投资方案比例。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金以提高对利率风险管理能力，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与国债期货投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析；构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本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，新华人寿保险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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 43,189.61 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,737.32 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 45,926.93 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113046 | 金田转债 | 226,010.27 | 0.09 |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 太平睿盈混合 A | 太平睿盈混合 C |
|---|---|---|

| | | |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 159,949,209.09 | 54,985,954.03 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 827,652.82 | 8,021,722.16 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,071,009.24 | 30,985,104.28 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 159,705,852.67 | 32,022,571.91 |

# §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

# §8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 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 | 20260701 - 20260930 | 149,816,912.51 | - | - | 149,816,912.51 | 78.1402 |
| 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。 | | | | | | | |

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §9 备查文件目录

## 9.1 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、《太平睿盈混合型证券投资基金基金合同》

3、《太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书》

4、《太平睿盈混合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

## 9.2 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,5 楼 503A)

## 9.3 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**

**2026 年 10 月 27 日**