

太平睿安混合型证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 7 月 18 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 2022 年 04 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	太平睿安混合
基金主代码	010268
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 10 日
报告期末基金份额总额	431,462,531.17 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 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。 2、 债券投资策略 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。 (1) 利率策略 本基金研究 GDP、物价、就业、国际收支等国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。 组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，综合宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，可以制定出组合的目标久期，预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期，以规避债券价格下降的风险和资本损失，获得较高的再投资收益；预期市场利率将下降时，提高组合的久期，在市场利率实际下降时获得债券价格上升的收益，并获得较高利息收入。 (2) 期限配置策略 在短期利率期限结构分析的基础上，根据对投资对象流动性和收益性的动态考察，构建合理期限结构的投资组合。从组合总的剩余期限结构来看，一般说来，预期利率上涨时，将适当缩短组合的平均剩余期限；预期利率下降时，将在法律法规允许的范围内适当延长组合的平均剩余期限。 (3) 信用债投资策略 本基金所指信用债包括：金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债和中期票据等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用担保的固定收益类金融工具。 本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产的 20%，并且不得投资于信用评级低于 AA+ 的信用债，其中投资于 AA+ 评级信用债的比例不超过信用债资产总值的 50%，投资于 AAA 评级信用债的比例占信用债资产总值的 50%-100%。 金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、资产支持证券、次级债和中期票据等信用债的信用评级依照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级；短期融资券和超短期融资券等信用债的信用评级依照基金管理人选定评级机构出具的主体信用评级。 信用债券相对国债等利率产品的信用利差是获取较高投资收益的来源，本基金将通过重点投资信用类债券，提高整体收益能力。本管理人在内部信用评级的基础上和内部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。 债券的信用利差主要受两个方面的影响，一是市场信用
--	--

	利差曲线的走势；二是债券本身的信用变化。本基金通过对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等分析，判断市场信用利差曲线整体及分行业走势，确定各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资。 （4）中小企业私募债券投资策略 中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。 针对市场系统性信用风险，本基金主要通过调整中小企业私募债类属资产的配置比例，谋求避险增收。 针对非系统性信用风险，本基金通过分析发债主体的信用水平及个债增信措施，量化比较判断估值，精选个债，谋求避险增收。 本基金主要采取买入持有到期策略；当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取“尽早出售”策略，控制投资风险。 另外，部分中小企业私募债内嵌转股选择权，本基金将通过深入的基本面分析及定性定量研究，自下而上地精选个债，在控制风险的前提下，谋求内嵌转股权潜在的增强收益。 3、股票投资策略 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。 （1）行业配置策略 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。 （2）个股精选策略 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。 1) 公司质量评估 在对行业进行充分评估的基础上，深入调研上市公司，基于公司竞争优势、发展战略、治理结构、管理水平和估值比较等关键因素，预测中长期发展前景，重点关注上市公司的成长性和核心竞争力。 从以下几个方面进行分析： 公司所处行业前景：所处行业具有良好的发展趋势；行业规模、行业景气周期、竞争格局等方面有利于公司持续提升市占率和盈利能力。 公司核心竞争力：公司在生产、技术、市场、创新、资
--	--

	源、品牌等一个或多个方面占据领先地位或具有显著的成长性，能够保持竞争优势。 公司治理结构：公司管理层稳定、高效，具有良好的战略视野和执行能力，并能根据形势的变化灵活地做出调整和应对等。 公司盈利能力：公司具有良好的财务结构、资产状况、盈利指标、成本管控能力、现金流特征，经营和发展具有长期可持续性。 2) 价值评估 本基金将结合市场阶段特点及行业特征，选取相应的相对估值指标（如 P/B、P/E、EV/EBITDA、PEG、PS 等）和绝对估值指标（如 DCF、NAV、FCFF、DDM、EVA 等）对上市公司进行估值分析，精选财务健康、持续成长、估值存在提升空间的股票。 3) 新股申购策略 本基金将深入研究首次公开发行股票或增发新股的上市公司基本面，根据股票市场整体估值水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，制定相应的新股申购策略。 本基金还将结合研究员的实地调查研究，并按照投资决策程序，构建本基金的股票投资组合并进行动态调整。 4、 股指期货投资策略 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，当现货全部平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、 国债期货投资策略 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。 6、 资产支持证券投资策略
--	---

	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	本基金的业绩比较基准为：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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C
下属分级基金的交易代码	010268	010269
报告期末下属分级基金的份额总额	423,865,687.13 份	7,596,844.04 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（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）	
	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C
1. 本期已实现收益	-26,568,679.14	-416,084.94
2. 本期利润	30,743,083.24	620,142.85
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0625	0.0805
4. 期末基金资产净值	432,025,328.03	7,678,526.46
5. 期末基金份额净值	1.0193	1.0108

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

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

太平睿安混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率基准	业绩比较基准	业绩比较基准	①—③	②—④
----	--------	---------	--------	--------	-----	-----

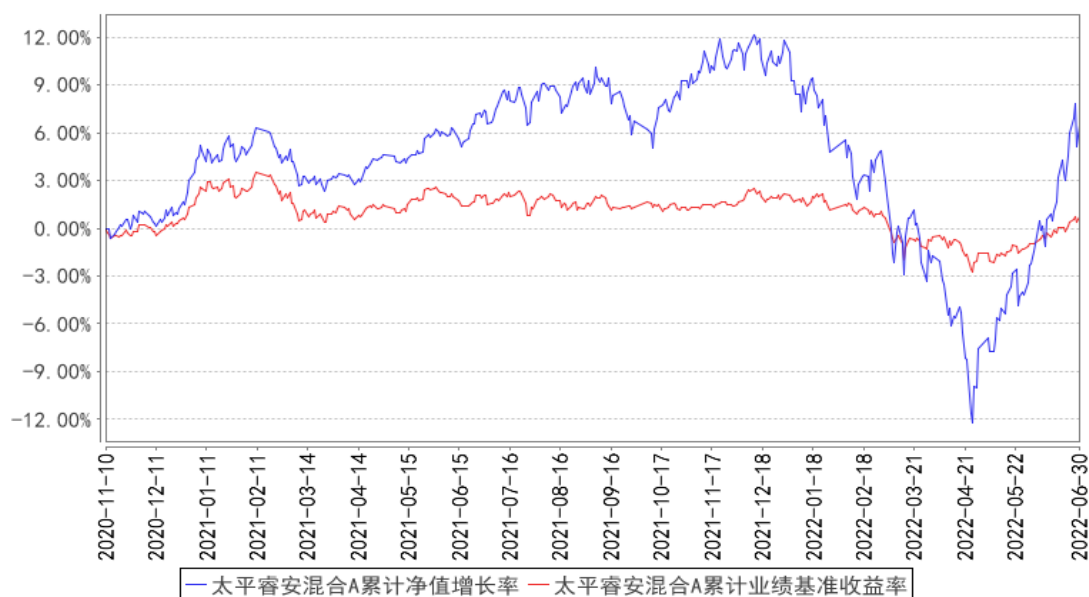
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	8.81%	1.20%	1.55%	0.28%	7.26%	0.92%
过去六个月	-4.77%	1.14%	-1.42%	0.29%	-3.35%	0.85%
过去一年	-0.93%	0.88%	-1.29%	0.25%	0.36%	0.63%
自基金合同 生效起至今	6.45%	0.72%	0.73%	0.25%	5.72%	0.47%

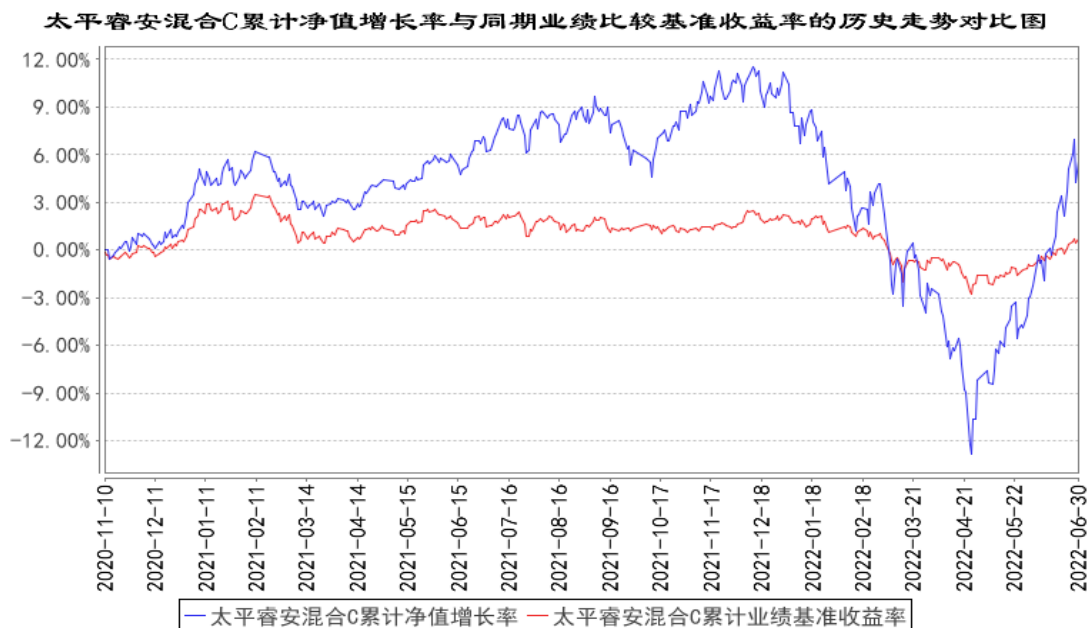
太平睿安混合 C

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	8.68%	1.20%	1.55%	0.28%	7.13%	0.92%
过去六个月	-5.01%	1.14%	-1.42%	0.29%	-3.59%	0.85%
过去一年	-1.41%	0.88%	-1.29%	0.25%	-0.12%	0.63%
自基金合同 生效起至今	5.59%	0.72%	0.73%	0.25%	4.86%	0.47%

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

太平睿安混合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





注：本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 10 日，本基金的建仓期为六个月，建仓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		
陈晓	固定收益投资部总监、本基金的基金经理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理、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、太平丰盈一年定期开放	2020 年 11 月 10 日	—	11 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。2014 年 1 月先后担任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安和债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安诚债券型证券投资基金基金经理、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 11 月加入太平基金管理有限公司，现任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

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、太平睿庆混合型证券投资基金基金经理、太平安元债券型证券投资基金			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。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 日起担任太平安元债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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，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的相关制度等的有关规定，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

2022 年第二季度经济经历了一轮疫情影响，自 4 月底中央政治局会议以来，政策持续加码稳增长、稳预期，各地方政府和部委积极响应，政策出台进度明显加快；从宏观数据看，4、5、6 月份数据持续环比改善，后续继续关注基本面修复力度。6 月以来，疫情防控取得成效，疫情防控政策边际调整，各地复工复产有序推进，同时在行程码“去星”、入境隔离天数减少等政策的影响下，此前受到抑制的线下消费活动将明显修复。整体二季度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，叠加地产政策进一步的边际放松，预计三季度需求端也将明显改善。

权益市场二季度在 4 月份筑底后迎来一轮强有力的反弹，尤其前期跌幅较多的高景气成长赛道板块，而 3-4 月份表现较好的稳增长板块则相对温和。无论是上证综指还是各主要宽基指数，基本已经反弹至 3 月疫情爆发前水平，基本抹平疫情带来的指数点位冲击。往后展望，疫情防控和经济发展更协调，稳增长政策仍有加力空间，关注制造业中汽车及零部件、机械设备、电子和通信制造行业，以及疫情后消费复苏改善的食品饮料、交运物流、地产后周期的家电家具等行业，还有政策一直大力支持且景气度较高的光伏风电、国防军工板块。

债券市场二季度整体较好，相较于一季度受到外围因素干扰较多，二季度市场主要矛盾集中在国内因素：因疫情影响导致市场判断经济数据不达预期，对于经济增速中枢预期下调。后续虽然各项刺激政策出炉，但需求端在二季度仍然疲软，同时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。

本报告期内，本基金保持权益板块超配的状态，二季度初以来行业配置方面适度倾向成长方向，同时提高行业和个股集中度，加强行业和个股研究，力争在风险可控的基础上增加收益。债券方面，纯债以中短久期利率债为主要配置，获得较为稳定的票息收益；同时，本基金深度参与可转债市场的投资机会，综合考虑绝对价格、溢价率和正股基本面等因素，在一季度末和二季度初市场调整过程中加大中低价板块转债左侧布局的配置力度。整体上通过股债平衡的思路进行仓位管理，利用不同板块的股票、可转债、债券协调优化大类资产配置，积极捕捉市场机会，力争为投资人取得较好的风险收益比。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平睿安混合 A 的份额净值增长率为 8.81%，同期业绩比较基准收益率为 1.55%；

太平睿安混合 C 的份额净值增长率为 8.68%，同期业绩比较基准为 1.55%。

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	175,210,598.33	39.67
	其中：股票	175,210,598.33	39.67
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	262,159,290.77	59.36
	其中：债券	262,159,290.77	59.36
	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	2,414,144.48	0.55
8	其他资产	1,848,140.02	0.42
9	合计	441,632,173.60	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	1,332,303.44	0.30
C	制造业	158,151,756.95	35.97
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	21,401.16	0.00
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	15,445,030.82	3.51
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00

M	科学研究和技术服务业	30,307.77	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	24,378.42	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	185,459.99	0.04
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	175,210,598.33	39.85

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	300298	三诺生物	688,220	19,338,982.00	4.40
2	300760	迈瑞医疗	30,000	9,396,000.00	2.14
3	601012	隆基绿能	138,600	9,234,918.00	2.10
4	002594	比亚迪	26,000	8,670,740.00	1.97
5	600690	海尔智家	310,000	8,512,600.00	1.94
6	002371	北方华创	23,800	6,595,456.00	1.50
7	600566	济川药业	220,000	5,975,200.00	1.36
8	300775	三角防务	120,000	5,778,000.00	1.31
9	300850	新强联	58,000	5,163,740.00	1.17
10	603916	苏博特	180,000	4,588,200.00	1.04

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	2,253,437.70	0.51
2	央行票据	—	—
3	金融债券	20,103,868.49	4.57
	其中：政策性金融债	20,103,868.49	4.57
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）	239,801,984.58	54.54
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	262,159,290.77	59.62

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	220401	22 农发 01	200,000	20,103,868.49	4.57
2	110081	闻泰转债	88,700	10,926,428.09	2.48
3	123121	帝尔转债	64,400	9,511,835.89	2.16
4	123107	温氏转债	70,000	9,190,510.96	2.09
5	113648	巨星转债	67,690	8,987,115.99	2.04

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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，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。

5.11.2 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

本报告期内，本基金投资的前十名股票中没有出现超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	148,041.23
2	应收证券清算款	1,699,724.03
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	374.76
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	1,848,140.02

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	110081	闻泰转债	10,926,428.09	2.48
2	123121	帝尔转债	9,511,835.89	2.16
3	123107	温氏转债	9,190,510.96	2.09
4	127027	靖远转债	8,887,474.53	2.02
5	118003	华兴转债	8,357,389.01	1.90
6	127045	牧原转债	8,089,063.69	1.84
7	113049	长汽转债	7,886,904.66	1.79
8	113047	旗滨转债	7,629,202.19	1.74
9	123067	斯莱转债	7,562,226.08	1.72
10	113621	彤程转债	7,029,047.95	1.60
11	123114	三角转债	6,475,385.79	1.47
12	110079	杭银转债	6,264,120.55	1.42
13	110052	贵广转债	6,158,052.58	1.40
14	113516	苏农转债	5,975,239.73	1.36
15	113025	明泰转债	5,140,343.84	1.17
16	127031	洋丰转债	5,043,895.89	1.15
17	113530	大丰转债	5,019,852.80	1.14
18	113635	升 21 转债	4,775,970.25	1.09
19	127030	盛虹转债	4,727,198.86	1.08
20	110045	海澜转债	4,275,942.08	0.97

21	128081	海亮转债	3,954,603.88	0.90
22	123060	苏试转债	3,816,986.30	0.87
23	113626	伯特转债	3,638,882.88	0.83
24	127018	本钢转债	3,539,897.26	0.81
25	113623	凤 21 转债	3,441,661.64	0.78
26	123120	隆华转债	3,033,460.66	0.69
27	113620	傲农转债	2,838,876.71	0.65
28	123083	朗新转债	2,787,053.42	0.63
29	110074	精达转债	2,643,383.42	0.60
30	113622	杭叉转债	2,492,718.36	0.57
31	127049	希望转 2	2,456,312.88	0.56
32	127020	中金转债	2,348,266.85	0.53
33	113632	鹤 21 转债	2,340,772.05	0.53
34	127012	招路转债	2,283,628.10	0.52
35	113563	柳药转债	2,272,476.71	0.52
36	113537	文灿转债	2,163,014.38	0.49
37	123078	飞凯转债	1,704,540.55	0.39
38	113629	泉峰转债	1,341,942.47	0.31
39	127032	苏行转债	1,136,001.37	0.26
40	113535	大业转债	1,129,142.47	0.26
41	113582	火炬转债	526,100.77	0.12
42	123090	三诺转债	193,264.66	0.04
43	123117	健帆转债	69,637.64	0.02

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	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C
报告期期初基金份额总额	581,292,616.80	7,761,690.07
报告期期间基金总申购份额	35,000.35	123,523.64
减:报告期期间基金总赎回份额	157,461,930.02	288,369.67
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	423,865,687.13	7,596,844.04

§ 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投资本基金。

§ 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	20220401-20220630	344,306,178.95			344,306,178.95	79.7998
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、《太平睿安混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平睿安混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平睿安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）

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：021-61560999、400-028-8699

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2022 年 7 月 21 日