

# 1. 太平睿盈混合型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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

送出日期：2021 年 3 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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的法律责任。本年度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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 23 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。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 11        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14        |
| 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             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 16        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17        |
| 4.9 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       | 17        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 18        |
| 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 | 18        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 18        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>18</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 18        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 18        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>20</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 20        |
| 7.2 利润表                                 | 21        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 22        |
| 7.4 报表附注                                | 24        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>55</b> |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 55        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 55        |
| 8.3 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 .....     | 56        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 58        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 59        |
| 8.6 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 .....    | 60        |
| 8.7 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 ..... | 60        |
| 8.8 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 ..... | 60        |
| 8.9 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 .....    | 60        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 60        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 60        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 61        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>62</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 62        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 63        |
| 9.3 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 .....      | 63        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                 | <b>63</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>64</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 64        |
| 11.2 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 .....      | 64        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 64        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 65        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 65        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 65        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 65        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 66        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>67</b> |
| 12.1 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 .....    | 67        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 68        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                    | <b>68</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 68        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 68        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 68        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金名称            | 太平睿盈混合型证券投资基金    |                  |
| 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  |                  |
| 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       |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 495,125,027.68 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                  |
| 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 | 314,850,788.72 份 | 180,274,238.96 份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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 | <p>1、资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>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。</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>(2) 个股精选策略</p> <p>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。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率 $\times$ 80%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

### 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                 | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 赵霖                         | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 021-38556613               | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | zhaolin@taipingfund.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 021-61560999/400-028-8699  | 95555                  |
| 传真          |      | 021-38556677               | 0755-83195201          |
| 注册地址        |      | 上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢        | 深圳市深南大道 7088 号招商银      |

|       |                                 |                      |
|-------|---------------------------------|----------------------|
|       | 101 室                           | 行大厦                  |
| 办公地址  | 上海市浦东新区银城中路 488 号<br>太平金融大厦 7 楼 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码  | 200120                          | 518040               |
| 法定代表人 | 范宇                              | 缪建民                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                     |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.taipingfund.com.cn      |
| 基金年度报告备置地点          | 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                                |
|--------|--------------------------|-------------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1<br>期间数<br>据和指<br>标 | 2020 年        |               | 2019 年 3 月 25 日(基<br>金合同生效<br>日)-2019 年 12 月 31<br>日 | 2019 年 8 月 13 日(基<br>金合同生效<br>日)-2019 年 12 月 31<br>日 |
|--------------------------|---------------|---------------|------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|
|                          | 太平睿盈混合 A      | 太平睿盈混合 C      | 太平睿盈混合 A                                             | 太平睿盈混合 C                                             |
| 本期已<br>实现收<br>益          | 42,748,215.73 | 27,156,728.97 | 8,557,978.74                                         | 2,254,097.70                                         |
| 本期利<br>润                 | 53,286,128.85 | 33,595,855.93 | 13,249,075.83                                        | 3,358,488.25                                         |
| 加权平<br>均基金<br>份额本<br>期利润 | 0.1980        | 0.2044        | 0.0637                                               | 0.0354                                               |
| 本期加<br>权平均<br>净值利<br>润率  | 17.94%        | 18.54%        | 6.26%                                                | 3.44%                                                |
| 本期基<br>金份额<br>净值增<br>长率  | 18.92%        | 18.33%        | 6.00%                                                | 3.83%                                                |

| 3.1.2<br>期末数<br>据和指<br>标 | 2020 年末        |                | 2019 年末        |                |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 期末可<br>供分配<br>利润         | 40,847,084.10  | 22,534,778.68  | 4,845,533.56   | 2,471,672.02   |
| 期末可<br>供分配<br>基金份<br>额利润 | 0.1297         | 0.1250         | 0.0197         | 0.0212         |
| 期末基<br>金资产<br>净值         | 373,498,807.02 | 212,326,822.82 | 255,258,347.11 | 121,069,411.09 |
| 期末基<br>金份额<br>净值         | 1.1863         | 1.1778         | 1.0396         | 1.0375         |
| 3.1.3<br>累计期<br>末指标      | 2020 年末        |                | 2019 年末        |                |
| 基金份<br>额累计<br>净值增<br>长率  | 26.06%         | 22.86%         | 6.00%          | 3.83%          |

### 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

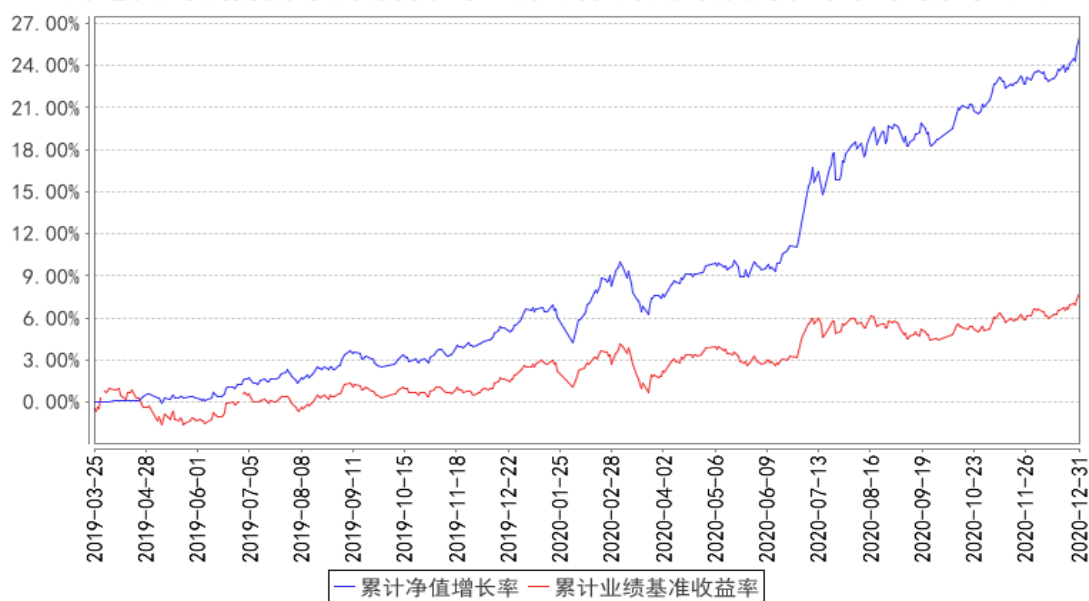
| 阶段             | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 6.17%        | 0.28%               | 3.15%          | 0.20%                 | 3.02%  | 0.08% |
| 过去六个月          | 13.04%       | 0.43%               | 4.08%          | 0.25%                 | 8.96%  | 0.18% |
| 过去一年           | 18.92%       | 0.40%               | 5.32%          | 0.27%                 | 13.60% | 0.13% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 26.06%       | 0.31%               | 7.75%          | 0.25%                 | 18.31% | 0.06% |

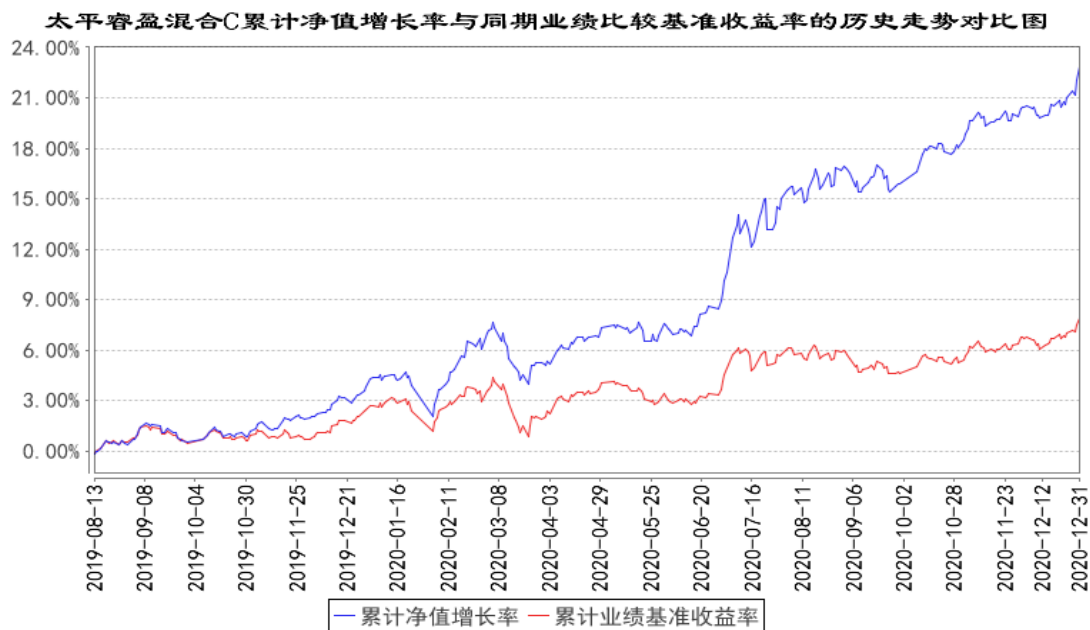
太平睿盈混合 C

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 6.02%    | 0.28%       | 3.15%      | 0.20%         | 2.87%  | 0.08% |
| 过去六个月      | 12.76%   | 0.43%       | 4.08%      | 0.25%         | 8.68%  | 0.18% |
| 过去一年       | 18.33%   | 0.40%       | 5.32%      | 0.27%         | 13.01% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.86%   | 0.35%       | 7.91%      | 0.24%         | 14.95% | 0.11% |

### 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

太平睿盈混合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

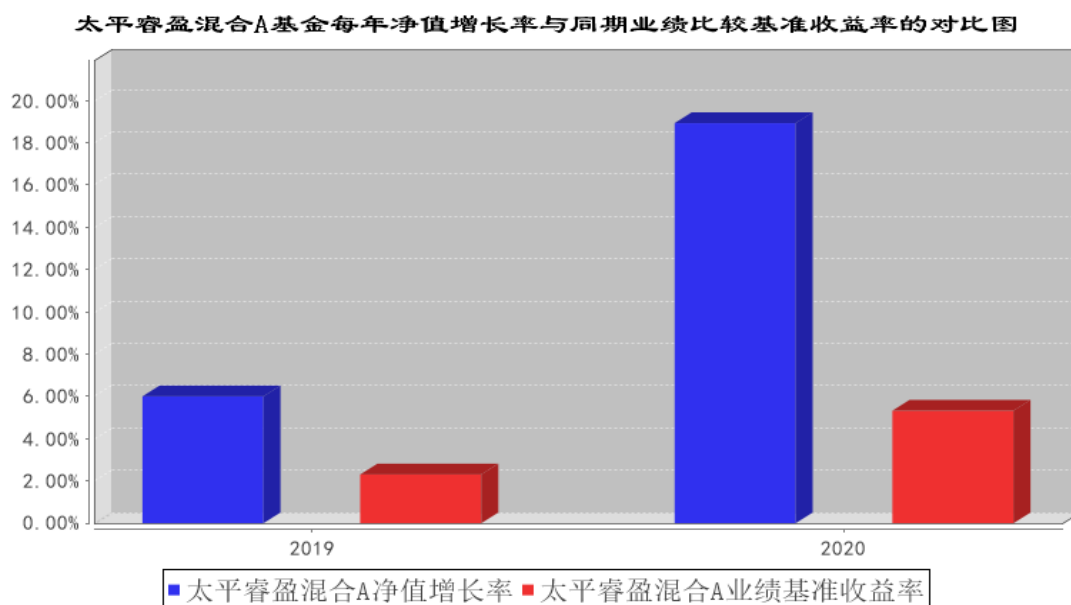




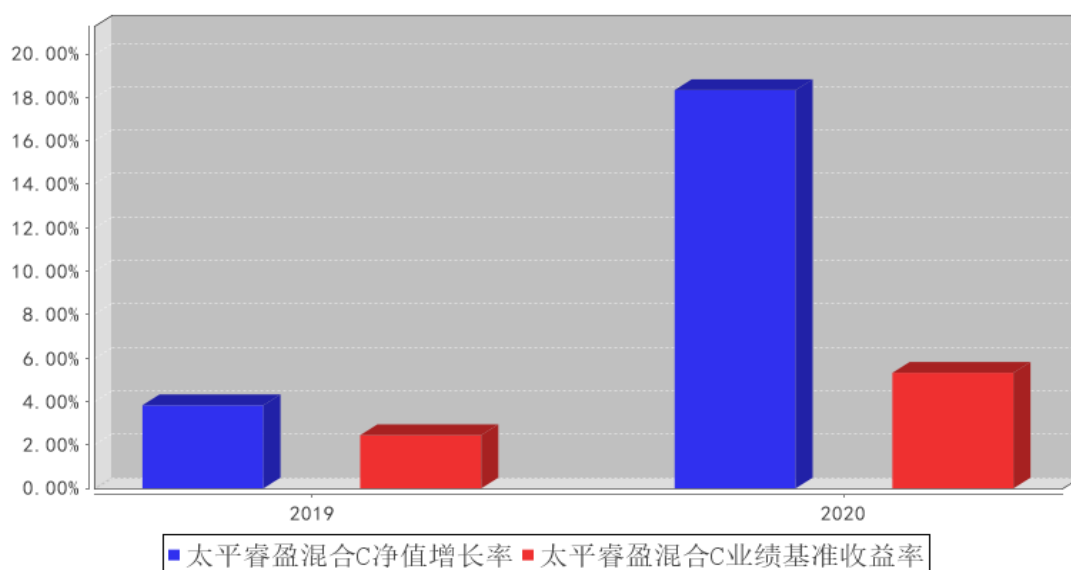
注：1. 本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 25 日，本基金建仓期为 6 个月，截至报告期末各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2019 年 3 月 25 日至 2020 年 12 月 31 日。

2. 本基金自 2019 年 8 月 13 日起增加 C 类基金份额。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：

- 1、本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 25 日，至本报告期末未满 5 年。
- 2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

太平睿盈混合 A

| 年度     | 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    | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|---------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 2020 年 | 0.4600        | 10,299,739.60 | 3,431,885.69 | 13,731,625.29 | -  |
| 2019 年 | 0.2000        | 3,890,259.75  | 1,003,904.48 | 4,894,164.23  | -  |
| 2018 年 | 0.0000        | 0.00          | 0.00         | -             | -  |
| 合计     | 0.6600        | 14,189,999.35 | 4,435,790.17 | 18,625,789.52 | -  |

太平睿盈混合 C

| 年度     | 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    | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|---------------|--------------|--------------|---------------|----|
| 2020 年 | 0.4600        | 7,049,389.01 | 2,954,810.46 | 10,004,199.47 | -  |
| 2019 年 | 0.2000        | 1,175,727.34 | 1,173,921.57 | 2,349,648.91  | -  |
| 2018 年 | 0.0000        | 0.00         | 0.00         | -             | -  |
| 合计     | 0.6600        | 8,225,116.35 | 4,128,732.03 | 12,353,848.38 | -  |

## § 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。目前公司注册资本为人民币 4 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 91.5%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 8.5%。

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 16 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。

#### 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、太平恒安三个月定期开 | 2019 年 3 月 25 日 | -    | 7 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 |

|    |                                                                                             |                 |          |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|----------|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    | 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、太平恒泽 63 个月定期开放债券型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 |                 |          |      | 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 陈晓 | 固定收益投资部总监、本基金的基金经理、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、太平睿安混合型证券投资基金基金经理                             | 2019 年 3 月 29 日 | -        | 10 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 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。 |
| 林开 | 本基金的                                                                                        | 2019 年 3        | 2020 年 4 | -    | 上海财经大学金融学专业证券投资方向硕                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

|    |                                                                                                                                                   |                    |        |     |                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|--------|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 盛  | 基金经<br>理、太平<br>灵活配置<br>混合型发<br>起式证券<br>投资基金<br>基金经<br>理、太平<br>MSCI 香港<br>价值增强<br>指数证券<br>投资基金<br>基金经<br>理、太平<br>行业优选<br>股票型证<br>券投资基<br>金基金经<br>理 | 月 25 日             | 月 13 日 |     | 士。具有证券投资基金从业资格。2009 年 7 月至 2016 年 4 月在申银万国证券研究所任首席分析师。2016 年 4 月加入本公司，从事投资研究相关工作。2017 年 5 月 9 日起担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 3 月 25 日至 2020 年 4 月 13 日担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 18 日起担任太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 1 日起担任太平行业优选股票型证券投资基金基金经理。 |
| 邵闯 | 本基金的<br>基金经<br>理助理、太平<br>睿安混<br>合型证<br>券投资基<br>金基金经<br>理助理                                                                                        | 2020 年 9<br>月 10 日 | -      | 3 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 月起在光大证券研究所从事研究分析工作。2020 年 3 月加入本公司，2020 年 9 月 10 日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理助理。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助理。                                                                                                               |

注：1、基金经理的任职日期和离任日期一般情况下指公司对外公告之日；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、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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，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 公平交易制度和控制方法

在内控制度方面，公司根据相关法律法规制订了规范的投资管理制度和公平交易管理制度，以确保公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，研究团队为公司所有投资组合提供平等、公平的研究支持，所有投资组合

共享公司统一的投资研究平台；严格实行各类资产管理业务之间的业务隔离和人员隔离制度，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，各投资组合的持仓及交易信息等均有效隔离。在交易执行方面，实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，保证交易在各投资组合间的公正实施。在监控和稽核方面，交易部门在交易执行过程中对公平交易实施一线监控与报告，稽核风控部对投资交易行为进行持续监督和评估，定期进行公平交易的分析工作，每季度和每年度对不同投资组合的收益率差异以及同向交易和反向交易情况进行分析，加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 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《证券投资基金管理人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。

#### 4.3.3 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

2020 年资本市场波动较大，权益与债券市场因为疫情与政策的以议案都表现出较大的波动。权益在一季度受到疫情冲击后恢复较快，并呈现出明显的结构性行情；债券市场收益率先大幅下行触及近两年低点随后大幅反弹。太平睿盈在 2020 年保持股债平衡的策略：股票底仓结构较好，全年通过积极调整匹配市场风格，较低仓位获得较好的绝对收益。同时参与新股申购有效增强了投资收益。债券方面，本基金主要以套息策略为主，辅以利率债交易策略，主要为 AAA 评级信用品种配置，同时保持中短久期以控制风险。全年通过股债平衡的思路进行仓位管理，利用动态的仓位调整来控制回撤风险，整体看有效控制了回撤的同时取得了超越基准的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平睿盈 A 的份额净值增长率为 18.92%，同期业绩比较基准收益率为 5.32%。  
太平睿盈 C 的份额净值增长率为 18.33%，同期业绩比较基准收益率为 5.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年对资本市场而言，疫情+政策是主线。权益市场在年初疫情爆发后大幅调整，随后一系列的支持政策出炉，加上国内疫情得到有效控制，权益市场大幅反弹。随着国内消费的逐渐复苏，权益板块轮番表现，权益基金一级发行量暴增，展现出较强的赚钱效应。债市整体先扬后抑，1-4 月，受新冠疫情影响，国内外宽松不断，债牛开启；5-7 月国内疫情得到控制、海外疫情持续发酵，货币政策由宽货币宽信用，到宽信用防风险，债市从牛陡走向熊平（利率熊而信用牛）；8 月以来，货币回归中性，债市熊平；11 月中旬以来，超预期信用违约事件爆发，央行超预期操作 MLF 等，债市出现反弹。

展望 2021 年预计经济基本面将持续复苏，疫情也将因为疫苗的出现将在全球范围内得到有效控制。在 2021 年一二季度由于去年的低基数效应经济名义同比增速将会较高，对股市带来一定支撑，但对债市带来一定的压力，同时货币政策逆周期调节措施将逐步退出，货币环境的边际收敛在经济上行阶段对资本市场也有较大的压力。社融增速在 2020 年底已经触及近期高点，随着社融增速、M2 增速的下行整体市场将迎来短暂的紧信用、紧货币环境。预计 2021 年下半年经济有一定的下行压力，届时国内政策可能会迎来边际微调。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。

在内控制度建设方面，公司持续完善内控制度建设，并时刻关注法规的新变化、结合行业发展的新动态、围绕业务开展的新需要，适时组织更新相关业务制度。在公司合规文化建设方面，公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，不断增强全体员工的合规自觉与风控意识，为公司业务的规范开展和健康发展创造良好的内控环境。在稽核检查方面，公司稽核风控部在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对各项业务活动进行监督、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，定期对各类业务开展情况以及公司整体运营情况进行覆盖全面、重点突出的检查、总结和反馈，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，进一步提

高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。公司估值委员会成员由主席负责，成员包括稽核风控部门负责人、量化投资部门负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。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。

#### 4.8 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《太平睿盈混合型证券投资基金基金合同》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 4 次，各基金份额类别每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 30%。

本基金管理人于 2020 年 07 月 15 日实施分红，分红方案为：A 级每 10 份基金发放红利 0.46 元；C 级每 10 份基金发放红利 0.46 元，均超过可供分配利润的 30%。

#### 4.9 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2021)第 22191 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题  | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 审计报告收件人 | 太平睿盈混合型证券投资基金全体基金份额持有人：                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 审计意见    | <p>我们审计了太平睿盈混合型证券投资基金(以下简称“太平睿盈混合基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了太平睿盈混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | 情况。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于太平睿盈混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 强调事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 其他事项            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 其他信息            | —                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>太平睿盈混合基金的基金管理人太平基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估太平睿盈混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算太平睿盈混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督太平睿盈混合基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对太平睿盈</p> |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | <p>混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致太平睿盈混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                        |     |
| 注册会计师的姓名  | 陈熹                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 金诗涛 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼                                                                                                                                                                                                                                                                         |     |
| 审计报告日期    | 2021 年 3 月 23 日                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：太平睿盈混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款        | 7.4.7.1 | 6,545,394.55            | 1,716,710.61             |
| 结算备付金       |         | 1,136,856.69            | 158,696.94               |
| 存出保证金       |         | 95,443.66               | 36,177.61                |
| 交易性金融资产     | 7.4.7.2 | 776,481,465.86          | 493,485,390.45           |
| 其中：股票投资     |         | 133,619,050.46          | 81,128,148.29            |
| 基金投资        |         | -                       | -                        |
| 债券投资        |         | 642,862,415.40          | 412,357,242.16           |
| 资产支持证券投资    |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资       |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产      | 7.4.7.3 | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产    | 7.4.7.4 | -                       | -                        |
| 应收证券清算款     |         | 17,693,778.24           | -                        |
| 应收利息        | 7.4.7.5 | 7,971,729.66            | 5,793,095.67             |
| 应收股利        |         | -                       | -                        |
| 应收申购款       |         | 109,362.56              | 10,000.00                |

|                 |            |                                 |                                  |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 810,034,031.22                  | 501,200,071.28                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                                 |                                  |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 202,176,479.55                  | 124,253,670.62                   |
| 应付证券清算款         |            | 21,152,375.94                   | -                                |
| 应付赎回款           |            | 40,503.53                       | 20,004.82                        |
| 应付管理人报酬         |            | 294,663.62                      | 190,058.43                       |
| 应付托管费           |            | 98,221.19                       | 63,352.82                        |
| 应付销售服务费         |            | 85,468.57                       | 51,123.21                        |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 106,883.52                      | 33,184.86                        |
| 应交税费            |            | 36,730.09                       | 40,429.80                        |
| 应付利息            |            | 37,075.13                       | 50,412.94                        |
| 应付利润            |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                               | -                                |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 180,000.24                      | 170,075.58                       |
| 负债合计            |            | 224,208,401.38                  | 124,872,313.08                   |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                                 |                                  |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 495,125,027.68                  | 362,237,456.75                   |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 90,700,602.16                   | 14,090,301.45                    |
| 所有者权益合计         |            | 585,825,629.84                  | 376,327,758.20                   |
| 负债和所有者权益总计      |            | 810,034,031.22                  | 501,200,071.28                   |

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 495,125,027.68 份，其中 A 类基金份额 314,850,788.72 份，基金份额净值 1.1863 元；C 类基金份额 180,274,238.96 份，基金份额净值 1.1778 元。

## 7.2 利润表

会计主体：太平睿盈混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目       | 附注号      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合<br>同生效日）至 2019 年 12 月<br>31 日 |
|-----------|----------|-------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| 一、收入      |          | 96,502,736.24                             | 20,157,773.25                                                |
| 1. 利息收入   |          | 16,375,886.03                             | 7,846,666.51                                                 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 89,586.79                                 | 569,291.24                                                   |

|                        |            |               |               |
|------------------------|------------|---------------|---------------|
| 债券利息收入                 |            | 16,271,496.01 | 7,148,530.54  |
| 资产支持证券利息收入             |            | -             | -             |
| 买入返售金融资产收入             |            | 14,803.23     | 128,844.73    |
| 证券出借利息收入               |            | -             | -             |
| 其他利息收入                 |            | -             | -             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 63,042,102.04 | 5,945,505.82  |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | 54,662,406.74 | 5,749,172.45  |
| 基金投资收益                 | -          | -             | -             |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | 6,156,372.48  | -463,991.74   |
| 资产支持证券投资收益             |            | -             | -             |
| 贵金属投资收益                |            | -             | -             |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.14   | -             | -             |
| 股利收益                   | 7.4.7.15   | 2,223,322.82  | 660,325.11    |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16   | 16,977,040.08 | 5,795,487.64  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -             | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.17   | 107,708.09    | 570,113.28    |
| 减：二、费用                 |            | 9,620,751.46  | 3,550,209.17  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 2,853,064.24  | 1,206,697.76  |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 951,021.48    | 402,232.54    |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | 900,383.53    | 189,350.95    |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.18   | 1,008,995.91  | 217,461.44    |
| 5. 利息支出                |            | 3,629,378.42  | 1,314,343.34  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 3,629,378.42  | 1,314,343.34  |
| 6. 税金及附加               |            | 41,576.06     | 19,557.15     |
| 7. 其他费用                | 7.4.7.19   | 236,331.82    | 200,565.99    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 86,881,984.78 | 16,607,564.08 |
| 减：所得税费用                |            | -             | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 86,881,984.78 | 16,607,564.08 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平睿盈混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日                |                |                 |
|----------------------------------------|-------------------------------------------------------|----------------|-----------------|
|                                        | 实收基金                                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 362,237,456.75                                        | 14,090,301.45  | 376,327,758.20  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                                     | 86,881,984.78  | 86,881,984.78   |
| 三、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)      | 132,887,570.93                                        | 13,464,140.69  | 146,351,711.62  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 311,063,443.21                                        | 36,098,095.48  | 347,161,538.69  |
| 2. 基金赎回款                               | -178,175,872.28                                       | -22,633,954.79 | -200,809,827.07 |
| 四、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) | -                                                     | -23,735,824.76 | -23,735,824.76  |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 495,125,027.68                                        | 90,700,602.16  | 585,825,629.84  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日 |                |                 |
|                                        | 实收基金                                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 229,947,908.95                                        | -              | 229,947,908.95  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                                     | 16,607,564.08  | 16,607,564.08   |
| 三、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)      | 132,289,547.80                                        | 4,726,550.51   | 137,016,098.31  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 235,954,979.63                                        | 5,066,145.64   | 241,021,125.27  |
| 2. 基金赎回款                               | -103,665,431.83                                       | -339,595.13    | -104,005,026.96 |

|                                        |                |               |                |
|----------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 回款                                     |                |               |                |
| 四、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） | -              | -7,243,813.14 | -7,243,813.14  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 362,237,456.75 | 14,090,301.45 | 376,327,758.20 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>尤象都</u> | <u>尤象都</u> | <u>孙波</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   |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

太平睿盈混合型证券投资基金(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[2017]1582 号《关于准予太平睿盈混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2019]178 号《关于太平睿盈混合型证券投资基金延期募集备案的回函》核准，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《太平睿盈混合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，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 229,908,125.22 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(2019)第 0198 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《太平睿盈混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 229,947,908.95 份基金份额，其中认购资金利息折合 39,783.73 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人太平基金管理股份有限公司于 2019 年 8 月 9 日发布的《关于太平睿盈混合型证券投资基金增加 C 类基金份额以及相应修改法律文件的公告》以及更新的《太平睿盈混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2019 年 8 月 13 日起，本基金根据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。在投资人申购时收取前端申购费用，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 类基金份额；在投资者申购时不收取前端申购费用，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《太平睿盈混合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(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货等及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-30%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率 $\times$ 80%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人太平基金管理有限公司于 2021 年 3 月 23 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》《太平睿盈混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终

止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实

现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照

中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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[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]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。

(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。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 6,545,394.55            | 1,716,710.61             |
| 定期存款 | -                       | -                        |
| 其他存款 | -                       | -                        |
| 合计   | 6,545,394.55            | 1,716,710.61             |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 |                |                |
|---------------|-------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 105,925,316.44          | 133,619,050.46 | 27,693,734.02  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场                   | 250,489,127.45 | 249,255,765.40 |
|               | 银行间市场                   | 397,294,494.25 | 393,606,650.00 |
|               | 合计                      | 647,783,621.70 | 642,862,415.40 |
| 资产支持证券        | -                       | -              | -              |
| 基金            | -                       | -              | -              |
| 其他            | -                       | -              | -              |
| 合计            | 753,708,938.14          | 776,481,465.86 | 22,772,527.72  |

| 项目            | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |                |                |
|---------------|--------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                       | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 77,550,185.57            | 81,128,148.29  | 3,577,962.72   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                        | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场                    | 82,248,660.11  | 84,058,342.16  |
|               | 银行间市场                    | 327,891,057.13 | 328,298,900.00 |
|               | 合计                       | 410,139,717.24 | 412,357,242.16 |
| 资产支持证券        | -                        | -              | -              |
| 基金            | -                        | -              | -              |
| 其他            | -                        | -              | -              |
| 合计            | 487,689,902.81           | 493,485,390.45 | 5,795,487.64   |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,040.09                | 832.41                   |
| 应收定期存款利息   | -                       | -                        |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 562.76                  | 78.54                    |
| 应收债券利息     | 7,970,079.51            | 5,792,166.79             |
| 应收资产支持证券利息 | -                       | -                        |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | -                        |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 应收出借证券利息   | -                       | -                        |
| 其他         | 47.30                   | 17.93                    |
| 合计         | 7,971,729.66            | 5,793,095.67             |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 98,976.14               | 24,973.19                |
| 银行间市场应付交易费用 | 7,907.38                | 8,211.67                 |
| 合计          | 106,883.52              | 33,184.86                |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 0.24                    | 75.58                    |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 预提信息披露费     | 120,000.00              | 110,000.00               |
| 预提审计费       | 60,000.00               | 60,000.00                |
| 合计          | 180,000.24              | 170,075.58               |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 太平睿盈混合 A

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                 |
|---------------|----------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额            |
| 上年度末          | 245,545,301.49                         | 245,545,301.49  |
| 本期申购          | 179,162,723.88                         | 179,162,723.88  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -109,857,236.65                        | -109,857,236.65 |
| -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           | 314,850,788.72                         | 314,850,788.72  |

##### 太平睿盈混合 C

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|----------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额           |
| 上年度末          | 116,692,155.26                         | 116,692,155.26 |
| 本期申购          | 131,900,719.33                         | 131,900,719.33 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -68,318,635.63                         | -68,318,635.63 |
| -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 | 180,274,238.96 | 180,274,238.96 |
|-----|----------------|----------------|

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

太平睿盈混合 A

| 项目                     | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末                   | 4,845,533.56   | 4,867,512.06  | 9,713,045.62   |
| 本期利润                   | 42,748,215.73  | 10,537,913.12 | 53,286,128.85  |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | 6,984,960.10   | 2,395,509.02  | 9,380,469.12   |
| 其中：基金申<br>购款           | 16,526,852.53  | 5,670,022.23  | 22,196,874.76  |
| 基金赎<br>回款              | -9,541,892.43  | -3,274,513.21 | -12,816,405.64 |
| 本期已分配利<br>润            | -13,731,625.29 | -             | -13,731,625.29 |
| 本期末                    | 40,847,084.10  | 17,800,934.20 | 58,648,018.30  |

太平睿盈混合 C

| 项目                     | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末                   | 2,471,672.02   | 1,905,583.81  | 4,377,255.83   |
| 本期利润                   | 27,156,728.97  | 6,439,126.96  | 33,595,855.93  |
| 本期基金份额<br>交易产生的变<br>动数 | 2,910,577.16   | 1,173,094.41  | 4,083,671.57   |
| 其中：基金申<br>购款           | 10,850,164.03  | 3,051,056.69  | 13,901,220.72  |
| 基金赎<br>回款              | -7,939,586.87  | -1,877,962.28 | -9,817,549.15  |
| 本期已分配利<br>润            | -10,004,199.47 | -             | -10,004,199.47 |
| 本期末                    | 22,534,778.68  | 9,517,805.18  | 32,052,583.86  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同<br>生效日）至 2019 年 12 月 31<br>日 |
|----------|----------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 74,596.10                              | 161,935.50                                                   |

|           |           |            |
|-----------|-----------|------------|
| 定期存款利息收入  | -         | 399,840.28 |
| 其他存款利息收入  | -         | -          |
| 结算备付金利息收入 | 13,998.40 | 7,258.52   |
| 其他        | 992.29    | 256.94     |
| 合计        | 89,586.79 | 569,291.24 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 355,608,180.65                         | 47,780,120.35                                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 300,945,773.91                         | 42,030,947.90                                         |
| 买卖股票差价收入   | 54,662,406.74                          | 5,749,172.45                                          |

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间<br>2019年3月25日（基金合同生效日）至2019年12月31日 |
|-------------------------|-----------------------------|--------------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 717,150,953.52              | 290,763,271.08                             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 702,989,821.42              | 288,389,525.90                             |
| 减：应收利息总额                | 8,004,759.62                | 2,837,736.92                               |
| 买卖债券差价收入                | 6,156,372.48                | -463,991.74                                |

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|               | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------------------|--------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 2,223,322.82                     | 660,325.11                                 |
| 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            | 2,223,322.82                     | 660,325.11                                 |

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |
|------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 16,977,040.08                             | 5,795,487.64                                          |
| 股票投资                   | 24,115,771.30                             | 3,577,962.72                                          |
| 债券投资                   | -7,138,731.22                             | 2,217,524.92                                          |
| 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                     | 16,977,040.08                             | 5,795,487.64                                          |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 107,553.98                                | 570,113.28                                            |
| 其他      | 154.11                                    | -                                                     |
| 合计      | 107,708.09                                | 570,113.28                                            |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 计入基金资产。

2. 本基金的转换费用由补差费和转出费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）<br>至 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 993,034.66                                | 205,048.94                                                |
| 银行间市场交易费用 | 15,961.25                                 | 12,412.50                                                 |
| 合计        | 1,008,995.91                              | 217,461.44                                                |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）<br>至 2019 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| 审计费用    | 60,000.00                                 | 60,000.00                                                 |
| 信息披露费   | 120,000.00                                | 110,000.00                                                |
| 证券出借违约金 | -                                         | -                                                         |
| 开户费     | -                                         | 400.00                                                    |
| 咨询服务费   | 1,200.00                                  | -                                                         |
| 银行划款手续费 | 19,131.82                                 | 14,665.99                                                 |
| 债券账户维护费 | 36,000.00                                 | 15,500.00                                                 |
| 合计      | 236,331.82                                | 200,565.99                                                |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

| 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 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人             |
| 太平资产管理有限公司（“太平资管”） | 基金管理人的股东          |
| 中原证券股份有限公司（“中原证券”） | 原基金管理人的股东         |
| 安石投资管理有限公司（“安石投资”） | 基金管理人的股东          |

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 经本基金的基金管理人太平基金管理有限公司(以下简称“太平基金”)股东会决议通过，并经中国证监会批复核准(证监许可[2019]2864 号)，太平基金管理有限公司原股东中原证券股份有限公司将所持太平基金 8.5%股权转让给太平资产管理有限公司，太平基金已于 2020

年 2 月 19 日完成工商变更。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,853,064.24                           | 1,206,697.76                                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 195,374.28                             | 62,776.10                                             |

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 0.60%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=前一日的基金资产净值×0.60%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|-------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 951,021.48                             | 402,232.54                                            |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日                |            |            |
|----------------|-------------------------------------------------------|------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                      |            |            |
|                | 太平睿盈混合 A                                              | 太平睿盈混合 C   | 合计         |
| 太平基金           | —                                                     | 752,115.51 | 752,115.51 |
| 合计             | —                                                     | 752,115.51 | 752,115.51 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                      |            |            |
|                | 太平睿盈混合 A                                              | 太平睿盈混合 C   | 合计         |
| 太平基金           | —                                                     | 166,383.30 | 166,383.30 |
| 合计             | —                                                     | 166,383.30 | 166,383.30 |

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 0.50%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 X 0.50%/ 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日                |               |      |       |      |       |      |
|-------------------------------------------------------|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                                    | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                                       | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 招商银行                                                  | -             | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |               |      |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                                    | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                                       | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 招商银行                                                  | 20,059,936.17 | -    | -     | -    | -     | -    |

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本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。

##### 7.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日 |            |
|------------|----------------------------------------|-----------|-------------------------------------------------------|------------|
|            | 期末余额                                   | 当期利息收入    | 期末余额                                                  | 当期利息收入     |
| 招商银行股份有限公司 | 6,545,394.55                           | 74,596.10 | 1,716,710.61                                          | 161,935.50 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 太平睿盈混合 A |                    |     |                    |                       |                   |                  |                   |    |
|----------|--------------------|-----|--------------------|-----------------------|-------------------|------------------|-------------------|----|
| 序号       | 权益<br>登记日          | 除息日 |                    | 每 10 份基<br>金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额      | 再投资形式<br>发放总额    | 本期利润<br>分配合计      | 备注 |
|          |                    | 场内  | 场外                 |                       |                   |                  |                   |    |
| 1        | 2020 年 7<br>月 15 日 | -   | 2020 年 7<br>月 15 日 | 0.4600                | 10,299,7<br>39.60 | 3,431,885.<br>69 | 13,731,6<br>25.29 | -  |
| 合计       | -                  | -   | -                  | 0.4600                | 10,299,7<br>39.60 | 3,431,885.<br>69 | 13,731,6<br>25.29 | -  |
| 太平睿盈混合 C |                    |     |                    |                       |                   |                  |                   |    |
| 序号       | 权益<br>登记日          | 除息日 |                    | 每 10 份基<br>金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额      | 再投资形式<br>发放总额    | 本期利润<br>分配合计      | 备注 |
|          |                    | 场内  | 场外                 |                       |                   |                  |                   |    |
| 1        | 2020 年 7<br>月 15 日 | -   | 2020 年 7<br>月 15 日 | 0.4600                | 7,049,38<br>9.01  | 2,954,810.<br>46 | 10,004,1<br>99.47 | -  |
| 合计       | -                  | -   | -                  | 0.4600                | 7,049,38<br>9.01  | 2,954,810.<br>46 | 10,004,1<br>99.47 | -  |

#### 7.4.12 期末(2020 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |          |                        |                       |            |          |            |                  |            |           |    |
|----------------------|----------|------------------------|-----------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|-----------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日              | 可流通<br>日              | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单<br>位：股) | 期末<br>成本总额 | 期末估值总额    | 备注 |
| 003030               | 祖名<br>股份 | 2020 年<br>12 月<br>25 日 | 2021<br>年 1 月<br>6 日  | 新股未<br>上市  | 15.18    | 15.18      | 480              | 7,286.40   | 7,286.40  | -  |
| 003031               | 中瓷<br>电子 | 2020 年<br>12 月<br>24 日 | 2021<br>年 1 月<br>4 日  | 新股未<br>上市  | 15.27    | 15.27      | 387              | 5,909.49   | 5,909.49  | -  |
| 300860               | 锋尚<br>文化 | 2020 年<br>8 月 6<br>日   | 2021<br>年 2 月<br>24 日 | 新股锁<br>定   | 138.02   | 126.67     | 228              | 31,468.56  | 28,880.76 | -  |
| 300861               | 美畅<br>股份 | 2020 年<br>8 月 6<br>日   | 2021<br>年 2 月<br>24 日 | 新股锁<br>定   | 43.76    | 51.10      | 662              | 28,969.12  | 33,828.20 | -  |

|        |      |                 |                 |      |       |        |     |           |           |   |
|--------|------|-----------------|-----------------|------|-------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| 300868 | 杰美特  | 2020 年 8 月 12 日 | 2021 年 2 月 24 日 | 新股锁定 | 41.26 | 43.28  | 593 | 24,467.18 | 25,665.04 | - |
| 300869 | 康泰医学 | 2020 年 8 月 12 日 | 2021 年 2 月 24 日 | 新股锁定 | 10.16 | 110.88 | 862 | 8,757.92  | 95,578.56 | - |
| 300870 | 欧陆通  | 2020 年 8 月 13 日 | 2021 年 2 月 24 日 | 新股锁定 | 36.81 | 65.67  | 478 | 17,595.18 | 31,390.26 | - |
| 300871 | 回盛生物 | 2020 年 8 月 13 日 | 2021 年 2 月 24 日 | 新股锁定 | 33.61 | 38.70  | 618 | 20,770.98 | 23,916.60 | - |
| 300872 | 天阳科技 | 2020 年 8 月 14 日 | 2021 年 2 月 25 日 | 新股锁定 | 21.34 | 37.84  | 871 | 18,587.14 | 32,958.64 | - |
| 300873 | 海晨股份 | 2020 年 8 月 14 日 | 2021 年 3 月 2 日  | 新股锁定 | 30.72 | 41.32  | 484 | 14,868.48 | 19,998.88 | - |
| 300877 | 金春股份 | 2020 年 8 月 17 日 | 2021 年 3 月 3 日  | 新股锁定 | 30.54 | 50.85  | 569 | 17,377.26 | 28,933.65 | - |
| 300878 | 维康药业 | 2020 年 8 月 17 日 | 2021 年 3 月 3 日  | 新股锁定 | 41.34 | 48.72  | 401 | 16,577.34 | 19,536.72 | - |
| 300879 | 大叶股份 | 2020 年 8 月 25 日 | 2021 年 3 月 1 日  | 新股锁定 | 10.58 | 27.12  | 466 | 4,930.28  | 12,637.92 | - |
| 300881 | 盛德鑫泰 | 2020 年 8 月 25 日 | 2021 年 3 月 5 日  | 新股锁定 | 14.17 | 32.31  | 291 | 4,123.47  | 9,402.21  | - |
| 300882 | 万胜智能 | 2020 年 8 月 27 日 | 2021 年 3 月 10 日 | 新股锁定 | 10.33 | 25.79  | 440 | 4,545.20  | 11,347.60 | - |
| 300886 | 华业香料 | 2020 年 9 月 8 日  | 2021 年 3 月 16 日 | 新股锁定 | 18.59 | 45.67  | 147 | 2,732.73  | 6,713.49  | - |
| 300887 | 谱尼测试 | 2020 年 9 月 9 日  | 2021 年 3 月 16 日 | 新股锁定 | 44.47 | 74.52  | 210 | 9,338.70  | 15,649.20 | - |
| 300889 | 爱克股份 | 2020 年 9 月 9 日  | 2021 年 3 月 16 日 | 新股锁定 | 27.97 | 30.12  | 479 | 13,397.63 | 14,427.48 | - |
| 300890 | 翔丰华  | 2020 年 9 月 10 日 | 2021 年 3 月      | 新股锁定 | 14.69 | 48.85  | 286 | 4,201.34  | 13,971.10 | - |

|        |      |                  |                 |      |        |        |       |           |            |   |
|--------|------|------------------|-----------------|------|--------|--------|-------|-----------|------------|---|
|        |      | 日                | 18 日            |      |        |        |       |           |            |   |
| 300891 | 惠云钛业 | 2020 年 9 月 10 日  | 2021 年 3 月 17 日 | 新股锁定 | 3.64   | 16.40  | 1,143 | 4,160.52  | 18,745.20  | - |
| 300892 | 品渥食品 | 2020 年 9 月 11 日  | 2021 年 3 月 24 日 | 新股锁定 | 26.66  | 60.01  | 272   | 7,251.52  | 16,322.72  | - |
| 300893 | 松原股份 | 2020 年 9 月 17 日  | 2021 年 3 月 24 日 | 新股锁定 | 13.47  | 35.08  | 276   | 3,717.72  | 9,682.08   | - |
| 300894 | 火星   | 2020 年 12 月 24 日 | 2021 年 7 月 1 日  | 新股锁定 | 14.07  | 36.97  | 628   | 8,835.96  | 23,217.16  | - |
| 300896 | 爱美客  | 2020 年 9 月 21 日  | 2021 年 3 月 29 日 | 新股锁定 | 118.27 | 603.36 | 246   | 29,094.42 | 148,426.56 | - |
| 300900 | 广联航空 | 2020 年 10 月 19 日 | 2021 年 4 月 29 日 | 新股锁定 | 17.87  | 33.16  | 879   | 15,707.73 | 29,147.64  | - |
| 300907 | 康平科技 | 2020 年 11 月 11 日 | 2021 年 5 月 18 日 | 新股锁定 | 14.30  | 26.85  | 473   | 6,763.90  | 12,700.05  | - |
| 300908 | 仲景食品 | 2020 年 11 月 13 日 | 2021 年 5 月 24 日 | 新股锁定 | 39.74  | 60.44  | 285   | 11,325.90 | 17,225.40  | - |
| 300910 | 瑞丰新材 | 2020 年 11 月 20 日 | 2021 年 5 月 27 日 | 新股锁定 | 30.26  | 47.87  | 474   | 14,343.24 | 22,690.38  | - |
| 300911 | 亿田智能 | 2020 年 11 月 24 日 | 2021 年 6 月 3 日  | 新股锁定 | 24.35  | 33.06  | 309   | 7,524.15  | 10,215.54  | - |
| 300917 | 特发服务 | 2020 年 12 月 14 日 | 2021 年 6 月 21 日 | 新股锁定 | 18.78  | 31.94  | 281   | 5,277.18  | 8,975.14   | - |
| 300918 | 南山智尚 | 2020 年 12 月 15 日 | 2021 年 6 月 22 日 | 新股锁定 | 4.97   | 8.94   | 1,063 | 5,283.11  | 9,503.22   | - |
| 300919 | 中伟股份 | 2020 年 12 月 15 日 | 2021 年 6 月 23 日 | 新股锁定 | 24.60  | 61.51  | 610   | 15,006.00 | 37,521.10  | - |
| 300922 | 天秦装备 | 2020 年 12 月 18 日 | 2021 年 6 月 25 日 | 新股锁定 | 16.05  | 31.58  | 287   | 4,606.35  | 9,063.46   | - |
| 300925 | 法本   | 2020 年           | 2021            | 新股锁  | 20.08  | 37.33  | 353   | 7,088.24  | 13,177.49  | - |

|        |      |             |            |       |       |       |        |            |              |   |
|--------|------|-------------|------------|-------|-------|-------|--------|------------|--------------|---|
|        | 信息   | 12月21日      | 年6月30日     | 定     |       |       |        |            |              |   |
| 300926 | 博俊科技 | 2020年12月29日 | 2021年1月7日  | 新股未上市 | 10.76 | 10.76 | 3,225  | 34,701.00  | 34,701.00    | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020年12月29日 | 2021年7月7日  | 新股锁定  | 10.76 | 10.76 | 359    | 3,862.84   | 3,862.84     | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020年12月29日 | 2021年1月7日  | 新股未上市 | 13.39 | 13.39 | 1,946  | 26,056.94  | 26,056.94    | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020年12月29日 | 2021年7月7日  | 新股锁定  | 13.39 | 13.39 | 217    | 2,905.63   | 2,905.63     | - |
| 300999 | 金龙鱼  | 2020年9月29日  | 2021年4月15日 | 新股锁定  | 25.70 | 88.29 | 3,680  | 94,576.00  | 324,907.20   | - |
| 601995 | 中金公司 | 2020年10月22日 | 2021年5月6日  | 新股锁定  | 28.78 | 68.71 | 24,951 | 718,089.78 | 1,714,383.21 | - |
| 605277 | 新亚电子 | 2020年12月25日 | 2021年1月6日  | 新股未上市 | 16.95 | 16.95 | 507    | 8,593.65   | 8,593.65     | - |
| 688093 | 世华科技 | 2020年9月22日  | 2021年3月30日 | 新股锁定  | 17.55 | 23.63 | 4,595  | 80,642.25  | 108,579.85   | - |
| 688155 | 先惠技术 | 2020年8月3日   | 2021年2月18日 | 新股锁定  | 38.77 | 67.26 | 2,403  | 93,164.31  | 161,625.78   | - |
| 688221 | 前沿生物 | 2020年10月20日 | 2021年4月28日 | 新股锁定  | 20.50 | 17.15 | 11,636 | 238,538.00 | 199,557.40   | - |
| 688378 | 奥来德  | 2020年8月26日  | 2021年3月3日  | 新股锁定  | 62.57 | 53.48 | 2,411  | 150,856.27 | 128,940.28   | - |
| 688560 | 明冠新材 | 2020年12月16日 | 2021年6月24日 | 新股锁定  | 15.87 | 22.86 | 3,832  | 60,813.84  | 87,599.52    | - |
| 688617 | 惠泰医疗 | 2020年12月30日 | 2021年1月7日  | 新股未上市 | 74.46 | 74.46 | 1,673  | 124,571.58 | 124,571.58   | - |

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|-------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|
|------|------|-------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|

|        |      |                  |                 |       |        |        | 位：张)  |            |            |   |
|--------|------|------------------|-----------------|-------|--------|--------|-------|------------|------------|---|
| 113044 | 大秦转债 | 2020 年 12 月 15 日 | 2021 年 1 月 15 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 280   | 28,000.00  | 28,000.00  | - |
| 123090 | 三诺转债 | 2020 年 12 月 21 日 | 2021 年 1 月 12 日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 1,250 | 125,000.00 | 125,000.00 | - |

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设

置不低于 6 个月的限售期。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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 80,299,479.55 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        |
|-----------|---------------|----------------|--------|---------|---------------|
| 200215    | 20 国开 15      | 2021 年 1 月 4 日 | 101.36 | 300,000 | 30,408,000.00 |
| 200406    | 20 农发 06      | 2021 年 1 月 4 日 | 99.76  | 200,000 | 19,952,000.00 |
| 101801032 | 18 陕煤化 MTN003 | 2021 年 1 月 7 日 | 101.71 | 100,000 | 10,171,000.00 |
| 101900531 | 19 太钢 MTN002  | 2021 年 1 月 7 日 | 101.43 | 100,000 | 10,143,000.00 |
| 101900661 | 19 中建材 MTN001 | 2021 年 1 月 7 日 | 100.91 | 150,000 | 15,136,500.00 |
| 合计        |               |                |        | 850,000 | 85,810,500.00 |

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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 121,877,000.00 元，截至 2021 年 7 月 1 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中高风险、中高预期收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货、权证等。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。

#### 7.4.13.2 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同责任，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招商银行，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。

#### 7.4.13.2.1 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<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 29,826,000.00           | 20,026,000.00            |
| 合计     | 29,826,000.00           | 20,026,000.00            |

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 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投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 9,716,000.00            | -                        |
| 合计     | 9,716,000.00            | -                        |

#### 7.4.13.2.4 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<br>2020 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 515,096,234.10          | 359,088,480.40           |
| AAA 以下 | 56,552,729.10           | 23,101,229.36            |
| 未评级    | 31,671,452.20           | 10,141,532.40            |
| 合计     | 603,320,415.40          | 392,331,242.16           |

注：未评级债券为国债、地方政府债和政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 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投资。

#### 7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 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 2020 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 202,176,479.55 元将在七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(所有者权益)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。

#### 7.4.13.3.1 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》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公司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 7.4.12。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 2020 年 12 月 31 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 2020 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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，此外还持有银行存款、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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 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                    | 6,545,394.55 | -     | -     | -   | 6,545,394.55 |

|                          |                |                |               |                |                |
|--------------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 结算备付金                    | 1,136,856.69   | -              | -             | -              | 1,136,856.69   |
| 存出保证金                    | 95,443.66      | -              | -             | -              | 95,443.66      |
| 交易性金融资产                  | 233,002,224.50 | 379,452,190.90 | 30,408,000.00 | 133,619,050.46 | 776,481,465.86 |
| 应收利息                     | -              | -              | -             | 7,971,729.66   | 7,971,729.66   |
| 应收申购款                    | -              | -              | -             | 109,362.56     | 109,362.56     |
| 应收证券清算款                  | -              | -              | -             | 17,693,778.24  | 17,693,778.24  |
| 资产总计                     | 240,779,919.40 | 379,452,190.90 | 30,408,000.00 | 159,393,920.92 | 810,034,031.22 |
| 负债                       | -              | -              | -             | -              | -              |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -             | 40,503.53      | 40,503.53      |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -             | 294,663.62     | 294,663.62     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 98,221.19      | 98,221.19      |
| 应付证券清算款                  | -              | -              | -             | 21,152,375.94  | 21,152,375.94  |
| 卖出回购金融资产款                | 202,176,479.55 | -              | -             | -              | 202,176,479.55 |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | 85,468.57      | 85,468.57      |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -             | 106,883.52     | 106,883.52     |
| 应付利息                     | -              | -              | -             | 37,075.13      | 37,075.13      |
| 应交税费                     | -              | -              | -             | 36,730.09      | 36,730.09      |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 180,000.24     | 180,000.24     |
| 负债总计                     | 202,176,479.55 | -              | -             | 22,031,921.83  | 224,208,401.38 |
| 利率敏感度缺口                  | 38,603,439.85  | 379,452,190.90 | 30,408,000.00 | 137,361,999.09 | 585,825,629.84 |
| 上年度末<br>2019 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                     | 1,716,710.61   | -              | -             | -              | 1,716,710.61   |
| 结算备付金                    | 158,696.94     | -              | -             | -              | 158,696.94     |
| 存出保证金                    | 36,177.61      | -              | -             | -              | 36,177.61      |
| 交易性金融资产                  | 45,516,862.90  | 338,649,149.50 | 28,191,229.76 | 81,128,148.29  | 493,485,390.45 |
| 应收利息                     | -              | -              | -             | 5,793,095.67   | 5,793,095.67   |
| 应收申购款                    | 500.00         | -              | -             | 9,500.00       | 10,000.00      |
| 资产总计                     | 47,428,948.06  | 338,649,149.50 | 28,191,229.76 | 86,930,743.96  | 501,200,071.28 |
| 负债                       | -              | -              | -             | -              | -              |
| 应付赎回款                    | -              | -              | -             | 20,004.82      | 20,004.82      |
| 应付管理人报酬                  | -              | -              | -             | 190,058.43     | 190,058.43     |
| 应付托管费                    | -              | -              | -             | 63,352.82      | 63,352.82      |
| 卖出回购金融资产款                | 124,253,670.62 | -              | -             | -              | 124,253,670.62 |
| 应付销售服务费                  | -              | -              | -             | 51,123.21      | 51,123.21      |
| 应付交易费用                   | -              | -              | -             | 33,184.86      | 33,184.86      |
| 应付税费                     | -              | -              | -             | 40,429.80      | 40,429.80      |
| 应付利息                     | -              | -              | -             | 50,412.94      | 50,412.94      |
| 其他负债                     | -              | -              | -             | 170,075.58     | 170,075.58     |
| 负债总计                     | 124,253,670.62 | -              | -             | 618,642.46     | 124,872,313.08 |
| 利率敏感度缺口                  | -76,824,722.56 | 338,649,149.50 | 28,191,229.76 | 86,312,101.50  | 376,327,758.20 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2020 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 个基点                                     | 4,553,870.83                | 1,607,065.72           |
|    | 市场利率上升 25 个基点                                     | -4,491,534.41               | -1,595,266.28          |

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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其他价格风险。

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%-30%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的

现金或者投资于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、应收申购款等。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 12 月 31 日 |               | 上年度末<br>2019 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  | 133,619,050.46          | 22.81         | 81,128,148.29            | 21.56         |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                       | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | —                       | —             | —                        | —             |
| 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            | 133,619,050.46          | 22.81         | 81,128,148.29            | 21.56         |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----|-------------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 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（2020 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
| 分析 | 沪深 300 指数上升 5%          | 6,563,723.62                | 3,398,776.93           |
|    | 沪深 300 指数下降 5%          | -6,563,723.62               | -3,398,776.93          |

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 217,309,233.54 元，属于第二层次的余额为 559,172,232.32 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 118,359,251.22 元，第二层次 375,126,139.23 元，无第三层次)。

(ii) 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公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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              | 133,619,050.46 | 16.50         |
|    | 其中：股票             | 133,619,050.46 | 16.50         |
| 2  | 基金投资              | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资            | 642,862,415.40 | 79.36         |
|    | 其中：债券             | 642,862,415.40 | 79.36         |
|    | 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      | 7,682,251.24   | 0.95          |
| 8  | 其他各项资产            | 25,870,314.12  | 3.19          |
| 9  | 合计                | 810,034,031.22 | 100.00        |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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              | —             | —             |
| C  | 制造业              | 89,271,043.18 | 15.24         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,748,000.00  | 0.98          |
| E  | 建筑业              | —             | —             |
| F  | 批发和零售业           | 16,322.72     | 0.00          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 12,088,063.88 | 2.06          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 64,852.37     | 0.01          |
| J  | 金融业              | 21,785,263.21 | 3.72          |
| K  | 房地产业             | 4,600,975.14  | 0.79          |
| L  | 租赁和商务服务业         | —             | —             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 15,649.20     | 0.00          |
| 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 | 28,880.76      | 0.00  |
| S | 综合        | -              | -     |
|   | 合计        | 133,619,050.46 | 22.81 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 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  | 601318 | 中国平安 | 70,000  | 6,088,600.00 | 1.04         |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 60,000  | 5,906,400.00 | 1.01         |
| 3  | 000001 | 平安银行 | 300,000 | 5,802,000.00 | 0.99         |
| 4  | 600900 | 长江电力 | 300,000 | 5,748,000.00 | 0.98         |
| 5  | 000651 | 格力电器 | 85,000  | 5,264,900.00 | 0.90         |
| 6  | 600031 | 三一重工 | 150,000 | 5,247,000.00 | 0.90         |
| 7  | 300298 | 三诺生物 | 140,000 | 5,012,000.00 | 0.86         |
| 8  | 600377 | 宁沪高速 | 516,500 | 4,756,965.00 | 0.81         |
| 9  | 002304 | 洋河股份 | 20,000  | 4,719,800.00 | 0.81         |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 149,880 | 4,646,280.00 | 0.79         |
| 11 | 000002 | 万科A  | 160,000 | 4,592,000.00 | 0.78         |
| 12 | 600309 | 万华化学 | 50,000  | 4,552,000.00 | 0.78         |
| 13 | 600009 | 上海机场 | 60,000  | 4,539,600.00 | 0.77         |
| 14 | 002332 | 仙琚制药 | 300,000 | 4,008,000.00 | 0.68         |
| 15 | 600519 | 贵州茅台 | 2,000   | 3,996,000.00 | 0.68         |
| 16 | 300274 | 阳光电源 | 50,000  | 3,614,000.00 | 0.62         |
| 17 | 002142 | 宁波银行 | 100,000 | 3,534,000.00 | 0.60         |
| 18 | 300750 | 宁德时代 | 10,000  | 3,511,100.00 | 0.60         |
| 19 | 300450 | 先导智能 | 40,000  | 3,359,600.00 | 0.57         |
| 20 | 600176 | 中国巨石 | 160,000 | 3,193,600.00 | 0.55         |
| 21 | 600104 | 上汽集团 | 130,300 | 3,184,532.00 | 0.54         |
| 22 | 300207 | 欣旺达  | 100,300 | 3,080,213.00 | 0.53         |
| 23 | 002601 | 龙蟠佰利 | 100,000 | 3,077,000.00 | 0.53         |
| 24 | 603187 | 海容冷链 | 49,996  | 2,999,760.00 | 0.51         |
| 25 | 002050 | 三花智控 | 120,813 | 2,978,040.45 | 0.51         |
| 26 | 600690 | 海尔智家 | 100,000 | 2,921,000.00 | 0.50         |
| 27 | 601021 | 春秋航空 | 50,000  | 2,771,500.00 | 0.47         |
| 28 | 600585 | 海螺水泥 | 50,000  | 2,581,000.00 | 0.44         |
| 29 | 600612 | 老凤祥  | 51,861  | 2,350,859.13 | 0.40         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 30 | 000895 | 双汇发展 | 50,000 | 2,347,000.00 | 0.40 |
| 31 | 600887 | 伊利股份 | 50,000 | 2,218,500.00 | 0.38 |
| 32 | 600885 | 宏发股份 | 40,000 | 2,168,800.00 | 0.37 |
| 33 | 603195 | 公牛集团 | 10,000 | 2,052,900.00 | 0.35 |
| 34 | 601995 | 中金公司 | 24,951 | 1,714,383.21 | 0.29 |
| 35 | 603799 | 华友钴业 | 20,000 | 1,586,000.00 | 0.27 |
| 36 | 300567 | 精测电子 | 25,000 | 1,373,500.00 | 0.23 |
| 37 | 300999 | 金龙鱼  | 3,680  | 324,907.20   | 0.06 |
| 38 | 688221 | 前沿生物 | 11,636 | 199,557.40   | 0.03 |
| 39 | 688155 | 先惠技术 | 2,403  | 161,625.78   | 0.03 |
| 40 | 300896 | 爱美客  | 246    | 148,426.56   | 0.03 |
| 41 | 688378 | 奥来德  | 2,411  | 128,940.28   | 0.02 |
| 42 | 688617 | 惠泰医疗 | 1,673  | 124,571.58   | 0.02 |
| 43 | 688093 | 世华科技 | 4,595  | 108,579.85   | 0.02 |
| 44 | 300869 | 康泰医学 | 862    | 95,578.56    | 0.02 |
| 45 | 688560 | 明冠新材 | 3,832  | 87,599.52    | 0.01 |
| 46 | 300926 | 博俊科技 | 3,584  | 38,563.84    | 0.01 |
| 47 | 300919 | 中伟股份 | 610    | 37,521.10    | 0.01 |
| 48 | 300861 | 美畅股份 | 662    | 33,828.20    | 0.01 |
| 49 | 300872 | 天阳科技 | 871    | 32,958.64    | 0.01 |
| 50 | 300870 | 欧陆通  | 478    | 31,390.26    | 0.01 |
| 51 | 300900 | 广联航空 | 879    | 29,147.64    | 0.00 |
| 52 | 300927 | 江天化学 | 2,163  | 28,962.57    | 0.00 |
| 53 | 300877 | 金春股份 | 569    | 28,933.65    | 0.00 |
| 54 | 300860 | 锋尚文化 | 228    | 28,880.76    | 0.00 |
| 55 | 300868 | 杰美特  | 593    | 25,665.04    | 0.00 |
| 56 | 300871 | 回盛生物 | 618    | 23,916.60    | 0.00 |
| 57 | 300894 | 火星人  | 628    | 23,217.16    | 0.00 |
| 58 | 300910 | 瑞丰新材 | 474    | 22,690.38    | 0.00 |
| 59 | 003026 | 中晶科技 | 460    | 21,693.60    | 0.00 |
| 60 | 300873 | 海晨股份 | 484    | 19,998.88    | 0.00 |
| 61 | 300878 | 维康药业 | 401    | 19,536.72    | 0.00 |
| 62 | 300891 | 惠云钛业 | 1,143  | 18,745.20    | 0.00 |
| 63 | 003029 | 吉大正元 | 716    | 18,716.24    | 0.00 |
| 64 | 003028 | 振邦智能 | 432    | 18,010.08    | 0.00 |
| 65 | 300908 | 仲景食品 | 285    | 17,225.40    | 0.00 |
| 66 | 605179 | 一鸣食品 | 939    | 16,582.74    | 0.00 |
| 67 | 300892 | 品渥食品 | 272    | 16,322.72    | 0.00 |
| 68 | 300887 | 谱尼测试 | 210    | 15,649.20    | 0.00 |
| 69 | 300889 | 爱克股份 | 479    | 14,427.48    | 0.00 |
| 70 | 300890 | 翔丰华  | 286    | 13,971.10    | 0.00 |
| 71 | 300925 | 法本信息 | 353    | 13,177.49    | 0.00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 72 | 300907 | 康平科技 | 473   | 12,700.05 | 0.00 |
| 73 | 300879 | 大叶股份 | 466   | 12,637.92 | 0.00 |
| 74 | 300882 | 万胜智能 | 440   | 11,347.60 | 0.00 |
| 75 | 605155 | 西大门  | 350   | 10,668.00 | 0.00 |
| 76 | 300911 | 亿田智能 | 309   | 10,215.54 | 0.00 |
| 77 | 300893 | 松原股份 | 276   | 9,682.08  | 0.00 |
| 78 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 9,503.22  | 0.00 |
| 79 | 300881 | 盛德鑫泰 | 291   | 9,402.21  | 0.00 |
| 80 | 300922 | 天秦装备 | 287   | 9,063.46  | 0.00 |
| 81 | 300917 | 特发服务 | 281   | 8,975.14  | 0.00 |
| 82 | 605277 | 新亚电子 | 507   | 8,593.65  | 0.00 |
| 83 | 003030 | 祖名股份 | 480   | 7,286.40  | 0.00 |
| 84 | 300886 | 华业香料 | 147   | 6,713.49  | 0.00 |
| 85 | 003031 | 中瓷电子 | 387   | 5,909.49  | 0.00 |

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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  | 000002 | 万 科 A | 17,286,589.00 | 4.59           |
| 2  | 000001 | 平安银行  | 10,238,188.00 | 2.72           |
| 3  | 300454 | 深信服   | 8,177,714.00  | 2.17           |
| 4  | 002142 | 宁波银行  | 6,673,556.60  | 1.77           |
| 5  | 002332 | 仙琚制药  | 6,574,962.89  | 1.75           |
| 6  | 601318 | 中国平安  | 6,287,676.00  | 1.67           |
| 7  | 601166 | 兴业银行  | 5,938,500.00  | 1.58           |
| 8  | 002228 | 合兴包装  | 5,829,414.70  | 1.55           |
| 9  | 000333 | 美的集团  | 5,535,900.00  | 1.47           |
| 10 | 300298 | 三诺生物  | 5,458,163.00  | 1.45           |
| 11 | 601668 | 中国建筑  | 5,171,413.32  | 1.37           |
| 12 | 601128 | 常熟银行  | 5,105,000.00  | 1.36           |
| 13 | 601601 | 中国太保  | 5,043,200.00  | 1.34           |
| 14 | 600377 | 宁沪高速  | 4,843,370.00  | 1.29           |
| 15 | 000651 | 格力电器  | 4,836,200.00  | 1.29           |
| 16 | 300059 | 东方财富  | 4,723,834.60  | 1.26           |
| 17 | 601108 | 财通证券  | 4,609,500.00  | 1.22           |
| 18 | 002439 | 启明星辰  | 4,597,257.00  | 1.22           |
| 19 | 600009 | 上海机场  | 4,398,744.00  | 1.17           |
| 20 | 600276 | 恒瑞医药  | 4,263,807.00  | 1.13           |

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。

#### 8.4.2 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  | 000002 | 万 科 A | 13,515,455.00 | 3.59           |
| 2  | 300454 | 深信服   | 8,620,934.00  | 2.29           |
| 3  | 000001 | 平安银行  | 8,007,793.00  | 2.13           |
| 4  | 688981 | 中芯国际  | 7,570,612.39  | 2.01           |
| 5  | 601668 | 中国建筑  | 6,541,841.60  | 1.74           |
| 6  | 601398 | 工商银行  | 6,430,200.00  | 1.71           |
| 7  | 601166 | 兴业银行  | 6,035,500.00  | 1.60           |
| 8  | 601601 | 中国太保  | 5,952,345.00  | 1.58           |
| 9  | 600588 | 用友网络  | 5,696,484.00  | 1.51           |
| 10 | 000333 | 美的集团  | 5,526,400.00  | 1.47           |
| 11 | 601128 | 常熟银行  | 5,251,230.00  | 1.40           |
| 12 | 601006 | 大秦铁路  | 5,243,000.00  | 1.39           |
| 13 | 002439 | 启明星辰  | 5,115,939.00  | 1.36           |
| 14 | 601211 | 国泰君安  | 5,086,182.00  | 1.35           |
| 15 | 002228 | 合兴包装  | 5,069,902.64  | 1.35           |
| 16 | 600276 | 恒瑞医药  | 5,007,440.00  | 1.33           |
| 17 | 002241 | 歌尔股份  | 4,523,500.00  | 1.20           |
| 18 | 601108 | 财通证券  | 4,443,500.00  | 1.18           |
| 19 | 002949 | 华阳国际  | 4,378,946.00  | 1.16           |
| 20 | 300122 | 智飞生物  | 4,350,000.00  | 1.16           |

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。

#### 8.4.3 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 | 332,614,306.33 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 355,608,180.65 |

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 11,075,080.00  | 1.89         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 230,739,000.00 | 39.39        |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,360,000.00  | 8.60         |
| 4  | 企业债券      | 30,936,000.00  | 5.28         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 272,724,650.00 | 46.55        |

|    |           |                |        |
|----|-----------|----------------|--------|
| 7  | 可转债（可交换债） | 87,594,113.30  | 14.95  |
| 8  | 同业存单      | 9,716,000.00   | 1.66   |
| 9  | 其他        | 77,572.10      | 0.01   |
| 10 | 合计        | 642,862,415.40 | 109.74 |

#### 8.6 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  | 175272 | 20 银河 G2 | 400,000 | 40,204,000.00 | 6.86         |
| 2  | 155287 | 19 平证 03 | 400,000 | 40,188,000.00 | 6.86         |
| 3  | 112729 | 18 申宏 02 | 300,000 | 30,936,000.00 | 5.28         |
| 4  | 200215 | 20 国开 15 | 300,000 | 30,408,000.00 | 5.19         |
| 5  | 110059 | 浦发转债     | 233,390 | 23,759,102.00 | 4.06         |

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 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。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

##### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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，中国工商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司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。

除上述情形外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责处罚的情况。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 95,443.66     |
| 2  | 应收证券清算款 | 17,693,778.24 |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 7,971,729.66  |
| 5  | 应收申购款   | 109,362.56    |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 25,870,314.12 |

#### 8.12.4 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  | 110059 | 浦发转债     | 23,759,102.00 | 4.06         |
| 2  | 110063 | 鹰 19 转债  | 6,465,957.30  | 1.10         |
| 3  | 132011 | 17 浙报 EB | 6,288,240.00  | 1.07         |

|    |        |          |              |      |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 4  | 128107 | 交科转债     | 5,965,463.08 | 1.02 |
| 5  | 127012 | 招路转债     | 4,176,400.00 | 0.71 |
| 6  | 113009 | 广汽转债     | 3,216,527.60 | 0.55 |
| 7  | 132007 | 16 凤凰 EB | 3,086,610.30 | 0.53 |
| 8  | 113014 | 林洋转债     | 3,051,720.00 | 0.52 |
| 9  | 110067 | 华安转债     | 1,770,300.00 | 0.30 |
| 10 | 113017 | 吉视转债     | 1,767,493.20 | 0.30 |
| 11 | 113528 | 长城转债     | 1,708,035.60 | 0.29 |
| 12 | 110057 | 现代转债     | 1,113,633.30 | 0.19 |

#### 8.12.5 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不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额<br>级<br>别                | 持有人户<br>数（户） | 户均持有的<br>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<br>例（%） | 持有份额          | 占总份额比<br>例（%） |
| 太平<br>睿<br>盈<br>混<br>合<br>A | 381          | 826,380.02    | 304,038,207.69 | 96.5658       | 10,812,581.03 | 3.4342        |
| 太平<br>睿<br>盈<br>混<br>合<br>C | 2,801        | 64,360.67     | 171,456,930.99 | 95.1089       | 8,817,307.97  | 4.8911        |
| 合<br>计                      | 3,156        | 156,883.72    | 475,495,138.68 | 96.0354       | 19,629,889.00 | 3.9646        |

注：在同一基金账号同时持有 A 类份额和 C 类份额的情况下，按一户统计持有人户数。

## 9.2 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 | 太平睿盈混合 A | 449,915.36   | 0.1429      |
|                  | 太平睿盈混合 C | 1,013,640.31 | 0.5623      |
|                  | 合计       | 1,463,555.67 | 0.2956      |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 太平睿盈混合 A | 0~10              |
|                                | 太平睿盈混合 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 太平睿盈混合 A | 0                 |
|                                | 太平睿盈混合 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |

## § 10 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       |
|----------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日<br>（2019 年 3 月 25 日）<br>基金份额总额 | 229,947,908.95 | —              |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 245,545,301.49 | 116,692,155.26 |
| 本报告期基金总申购份额                            | 179,162,723.88 | 131,900,719.33 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | 109,857,236.65 | 68,318,635.63  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）               | —              | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 314,850,788.72 | 180,274,238.96 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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 2020 年 1 月 23 日发布公告，自 2020 年 1 月 22 日起：范宇先生担任公司董事长；汤海涛先生因组织调动，不再担任公司董事长职务；王健先生、金芳女士、宋卫华先生均不再担任公司副总经理职务。

(2) 本基金管理人于 2020 年 3 月 7 日发布公告，自 2020 年 3 月 6 日起公司法定代表人变更为范宇先生。

(3) 本基金管理人于 2020 年 4 月 24 日发布公告，自 2020 年 4 月 22 日起尤象都先生担任公司总经理。

(4) 本基金管理人于 2020 年 4 月 30 日发布公告，自 2020 年 4 月 29 日起季勇先生担任公司副总经理。

(5) 本基金管理人于 2020 年 6 月 24 日发布公告，自 2020 年 6 月 22 日起史彦刚先生担任公司副总经理。

(6) 本基金管理人于 2020 年 7 月 31 日发布公告，自 2020 年 7 月 29 日起吴东先生不再担任公司副总经理、首席信息官，尤象都先生担任公司首席信息官。

(7) 本基金管理人于 2020 年 8 月 1 日发布公告，自 2020 年 7 月 31 日起岳冲先生不再担任公司督察长，尤象都先生代为履行督察长职责。

(8) 本基金管理人于 2020 年 10 月 24 日发布公告，自 2020 年 10 月 23 日起王炯女士担任公司督察长，尤象都先生不再代任督察长。

(9) 本基金管理人于 2020 年 12 月 26 日发布公告，自 2020 年 12 月 24 日起王炯女士担任公司首席信息官，尤象都先生不再兼任首席信息官。

2、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。

### 11.3 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。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。本报告期内应支付的审计费用为人民币陆万元整。

#### 11.6 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。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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 |    |
| 海通证券股份有限公司 | 2      | 649,008,496.45 | 100.00%      | 468,650.69 | 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）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

本报告期内未新增席位。

### 11.7.2 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 |
| 海通证券股份有限公司 | 773,084,209.79 | 100.00%      | 1,687,372,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

### 11.8 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  | 太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要               | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 02 月 15 日 |
| 2  | 太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书（更新）                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 02 月 15 日 |
| 3  | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加汇林保大为销售机构并参加其费率优惠的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 02 月 20 日 |
| 4  | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加中正达广为销售机构并参加其费率优惠的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 03 月 12 日 |
| 5  | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告            | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 03 月 17 日 |
| 6  | 太平基金管理有限公司关于调整旗下基金在部分销售机构费率优惠活动的公告     | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 03 月 17 日 |
| 7  | 太平基金管理有限公司关于旗下基金定投转换业务及相关费率优惠的公告       | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 03 月 31 日 |
| 8  | 太平基金管理有限公司关于林开盛卸任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理的公告  | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 04 月 15 日 |
| 9  | 太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要               | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 04 月 16 日 |
| 10 | 太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书（更新）                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 04 月 16 日 |
| 11 | 关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告      | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 04 月 18 日 |
| 12 | 关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入业务的公告        | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 04 月 23 日 |
| 13 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金为销售机构并参加其费       | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 05 月 11 日 |

|    |                                                          |              |                     |
|----|----------------------------------------------------------|--------------|---------------------|
|    | 率优惠的公告                                                   |              |                     |
| 14 | 关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 06 月<br>15 日 |
| 15 | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销渠道费率优惠的公告                          | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 07 月<br>03 日 |
| 16 | 关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 07 月<br>07 日 |
| 17 | 太平睿盈混合型证券投资基金基金合同                                        | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 07 月<br>10 日 |
| 18 | 太平睿盈混合型证券投资基金托管协议                                        | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 07 月<br>10 日 |
| 19 | 太平基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分证券投资基金基金合同、托管协议的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 07 月<br>10 日 |
| 20 | 太平基金管理有限公司关于太平睿盈混合型证券投资基金分红公告                            | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 07 月<br>13 日 |
| 21 | 太平基金管理有限公司关于旗下基金增加北京植信基金为销售机构并参加其费率优惠的公告                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 09 月<br>18 日 |
| 22 | 关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 11 月<br>19 日 |
| 23 | 关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 11 月<br>25 日 |
| 24 | 关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 12 月<br>10 日 |
| 25 | 关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告                 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2020 年 12 月<br>18 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|------|----------------|------------|
|------|----------------|------------|

| 别                                                                                                                                          | 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  | 20200101—<br>20200706, 202<br>00716—<br>20201117 | 100,810,794.55 | 4,280,419.91  | 105,091,214.46 | 0.00           | 0        |
| 机构                                                                                                                                         | 2  | 20200101—<br>20201231                            | 128,779,515.30 | 73,549,657.88 | 0.00           | 202,329,173.18 | 40.8643  |
| 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。 |    |                                                  |                |               |                |                |          |

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

|   |
|---|
| 无 |
|---|

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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）

### 13.3 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](http://www.taipingfund.com.cn)

太平基金管理有限公司

2021 年 3 月 25 日