

太平睿盈混合型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 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	598,400,311.36 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	362,709,613.31 份	235,690,698.05 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	1、资产配置策略 本基金采取主动投资管理的投资模式。在深入研究国内外的宏观经济走势，跟踪资产市场环境变化，通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略，将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。其中，当权益市场资产价格明显上涨时，适当增加权益类资产配置比例；当权益市场处于下行周期且市场风险偏好下降时，适当增加固定收益类资产配置比例，并通过灵活运用衍生品合约的套期保值与对冲功能，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。 2、债券投资策略 本管理人将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对资产组合进行积极管理。 3、股票投资策略 本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资思路，精选优质价值型股票进行重点投资。 （1）行业配置策略 本基金的行业配置，将根据宏观经济形势、国家政策变化、各行业景气差异以及市场风险偏好等因素的变化，结合历史经验总结，对行业配置不断进行调整和优化。

	(2) 个股精选策略 研究员对上市公司进行深入分析和紧密调研, 精选行业景气向上、拥有显著竞争优势且估值存在提升空间的优质公司。本基金将选择合适时机, 对此类优质公司进行投资。 4、股指期货投资策略 本基金将根据对现货和期货市场的分析, 发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点, 采用股指期货在短期内取代部分现货, 获取市场敞口, 投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时, 为避免市场冲击, 提前建立股指期货多头头寸, 然后逐步买入现货并解除股指期货多头, 当完成现货建仓后将股指期货平仓; 空头套期保值指当基金需要卖出现货时, 先建立股指期货空头头寸, 然后逐步卖出现货并解除股指期货空头, 当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中, 将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性, 精细化确定投资方案比例。 5、国债期货投资策略 本基金以提高对利率风险管理能力, 在风险可控的前提下, 本着谨慎原则参与国债期货投资。国债期货作为利率衍生品的一种, 有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定, 结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析; 构建量化分析体系, 对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控, 在最大限度保证基金资产安全的基础上, 力求实现基金资产的长期稳定增值。 6、资产支持证券投资策略 本基金通过考量宏观经济走势、支持资产所在行业景气情况、资产池结构、提前偿还率、违约率、市场利率等因素, 预判资产池未来现金流变动; 研究标的证券发行条款, 预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响, 同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响, 在严格控制信用风险暴露程度的前提下, 通过信用研究和流动性管理, 选择风险调整后收益较高的品种进行投资。
业绩比较基准	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 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 101 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	太平睿盈混合 A	太平睿盈混合 C
本期已实现收益	24,821,270.50	14,958,150.19
本期利润	18,695,167.80	10,896,267.56
加权平均基金份额本期利润	0.0534	0.0491
本期加权平均净值利润率	4.55%	4.22%
本期基金份额净值增长率	4.72%	4.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	43,612,059.60	26,401,072.79

期末可供分配基金份额利润	0.1202	0.1120
期末基金资产净值	420,606,425.12	270,522,738.70
期末基金份额净值	1.1596	1.1478
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	32.01%	28.35%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

太平睿盈混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.94%	0.23%	-0.43%	0.17%	1.37%	0.06%
过去三个月	4.32%	0.24%	1.09%	0.20%	3.23%	0.04%
过去六个月	4.72%	0.34%	0.73%	0.27%	3.99%	0.07%
过去一年	18.38%	0.39%	4.84%	0.26%	13.54%	0.13%
自基金合同生效起至今	32.01%	0.32%	8.54%	0.25%	23.47%	0.07%

太平睿盈混合 C

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

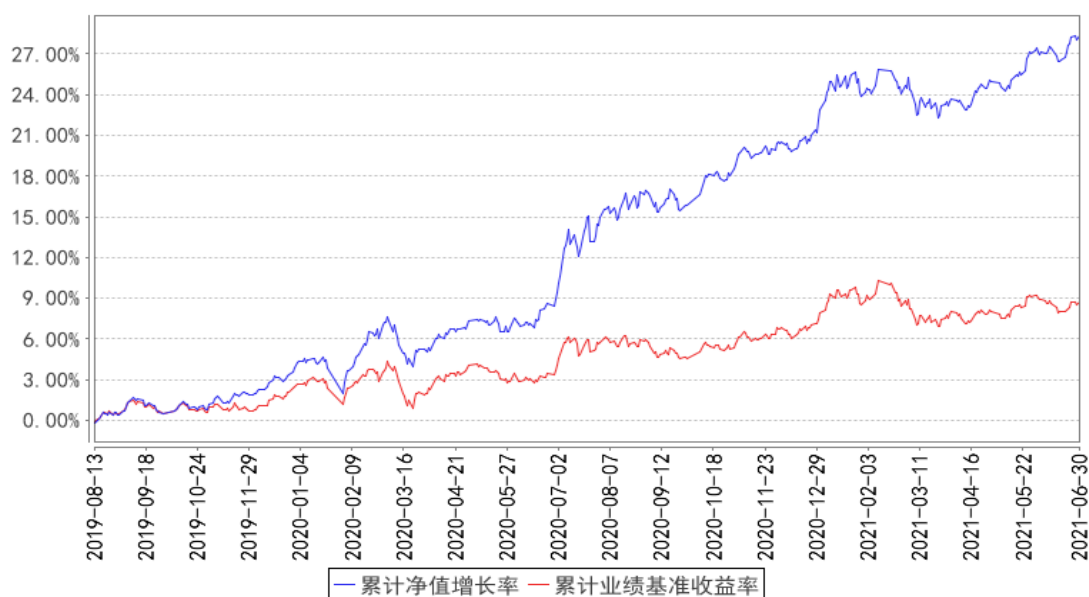
	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	0.90%	0.23%	-0.43%	0.17%	1.33%	0.06%
过去三个月	4.19%	0.24%	1.09%	0.20%	3.10%	0.04%
过去六个月	4.47%	0.34%	0.73%	0.27%	3.74%	0.07%
过去一年	17.80%	0.39%	4.84%	0.26%	12.96%	0.13%
自基金合同生效起至今	28.35%	0.35%	8.70%	0.25%	19.65%	0.10%

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



太平睿盈混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 25 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示 1 日期为 2019 年 3 月 25 日至 2021 年 6 月 30 日。

2、本基金自 2019 年 8 月 13 日起增加 C 类基金份额。图示 2 日期为 2019 年 8 月 13 日至 2021 年 6 月 30 日。

§ 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，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 19 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金、太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金、太平恒利纯债债券型证券投资基金、太平睿盈混合型证券投资基金、太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金、太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金、太平恒睿纯债债券型证券投资基金、太平中债 1-3

年政策性金融债指数证券投资基金、太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金、太平智选一年定期开放股票型发起式证券投资基金、太平行业优选股票型证券投资基金、太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平睿安混合型证券投资基金、太平恒久纯债债券型证券投资基金、太平价值增长股票型证券投资基金、太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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	2019 年 3 月 25 日	-	8 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 日起担任太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 12 日起担任太平恒久纯债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 24 日起担任太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

	资基金基金 基金经理、 太平丰泰 一年定期 开放债券 型发起式 证券投资 基金基金 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、太 平丰盈一 年定期开 放债券型 发起式证 券投资基 金基金经 理	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。2021 年 4 月 22 日起担任太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
邵闯	本基金的 基金经理 助理、太 平睿安混 合型证券 投资基金 基金经理 助理	2020 年 9 月 10 日	-	4 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、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；

2、证券从业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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年国内经济延续去年的复苏势头，在去年低基数基础上各项经济数据同比都有明显增长。经济高频数据在二季度略有回落，但整体宏观环境仍然稳中向好。

2021 年上半年债券市场整体呈现出 V 型走势。一季度表现较弱，主要由于一季度经济基本面较好，市场预期政策收紧概率上升，同时通胀压力是制约债券市场的重要因素。二季度债券板块整体表现较好，从 3 月开始至 5 月下旬债券持续了接近一个季度的慢牛行情，最大的支撑因素来自于货币政策未如预期般收紧。5 月开始由于国内定价的黑色系大宗商品出现暴涨，对债市造成一定冲击。但很快商品价格在政策打压下出现大幅调整，债市受到的压力大大缓解。6 月后在美债利率下行、央行加码 300 亿 OMO 投放等利好之下，市场情绪明显转暖。

权益市场方面，2021 上半年出现较大的振幅，同时风格方面也出现较大的切换。1 月初市场大幅上涨，尤其“茅指数”“核心资产”“顺周期”类概念板块出现较大涨幅。随后市场在春

节后出现较大调整，一方面前期抱团资产涨幅过大，市场开始担忧业绩增长无法弥补估值大幅上行带来的回调风险，抱团资产出现瓦解，尤其前期估值抬升较高的品种下跌较多，而低估值蓝筹品种则在调整过程中表现相对较好。从 3 月底开始权益市场内部结构分化异常明显：电力设备及新能源、汽车、半导体、医药医疗等板块涨幅明显，而金融、周期和消费类表现相对较弱。

转债市场方面，年初以来低价和平衡性转债溢价水平得到明显修复，新能源概念转债品种继续表现较好。

本报告期内，本基金谨慎投资股票市场，力争在风险可控的基础上增加收益。同时，参与新股申购以增强投资收益。债券方面，本基金主要以流动性管理为主，维持 AAA 评级信用品种配置，同时保持中短久期以控制风险。在转债上增加仓位参与转债市场。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，同时积极捕捉市场机会，力争为投资人取得稳定的收益。

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 4.72%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。太平睿盈 C 的份额净值增长率为 4.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为债市可预期的利好将逐步增多：通胀预期与通胀数据均已见顶，货币政策持续与之“脱钩”；经济下行拐点到来，虽然经济韧性较强，下行速度较为缓慢，但是监管仍然收紧，对于地产和地方债务政策不断收紧，在“宽货币、紧信用”的大环境下结构性缺资产的矛盾仍旧存在；美国紧缩预期以曲线平坦化形式实现，进程或慢于预期。因此对于债市而言，在经济潜在增速不断下行的大趋势下，收益率虽然会受到供需、流动性、外围市场等各方面的扰动，但长期来看仍将跟随经济基本面下行的概率较大。权益市场方面，受益于资本市场深化改革带来的红利，权益市场结构性机会较多，上半年高景气行业板块的个股可能仍将是未来市场追捧的热点，同时也需要关注受益于经济复苏有实际业绩驱动的行业，下半年的市场风格可能更趋向于均衡。另外一方面，由于下半年经济下行压力将逐渐显现，同时外围流动性收紧的压力预期越来越强，前期涨幅过高板块需要结合企业盈利预期兑现情况提防估值收缩带来的回调风险。整体上，我们认为无风险利率下行仍是未来资本市场长期趋势，利率债以及高评级信用债未来将更加受益，权益市场中结构性机会较大，但在过程中也需要警惕信用收缩带来的市场扰动以及内外宏观流动性变化的短期扰动。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以

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

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金资产的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值和产品委员会成员由主席负责，估值分委会常任委员由稽核风控部、投资部门（含权益投资部、专户业务部、固定收益投资部）、研究部、基金运营部等部门负责人担任；产品分委会常任委员由稽核风控部、销售部门（含市场销售部、机构客户部）、信息技术部、基金运营部、交易部、产品经理及其所在部门负责人、拟任基金经理或投资经理及其所在部门负责人担任。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及《太平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 2021 年 04 月 20 日实施分红，分红方案为：A 级每 10 份基金发放红利 0.8 元；C 级每 10 份基金发放红利 0.8 元，均超过可供分配利润的 30%。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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合规守信、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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：太平睿盈混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,733,137.65	6,545,394.55
结算备付金		3,982,112.74	1,136,856.69
存出保证金		43,430.67	95,443.66
交易性金融资产	6.4.7.2	840,577,221.45	776,481,465.86
其中：股票投资		133,749,161.61	133,619,050.46
基金投资		-	-
债券投资		706,828,059.84	642,862,415.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		14,908,385.20	17,693,778.24
应收利息	6.4.7.5	8,356,571.44	7,971,729.66
应收股利		-	-
应收申购款		63,836.81	109,362.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		872,664,695.96	810,034,031.22
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		164,747,000.00	202,176,479.55
应付证券清算款		15,712,671.07	21,152,375.94
应付赎回款		79,021.03	40,503.53
应付管理人报酬		337,873.84	294,663.62
应付托管费		112,624.61	98,221.19
应付销售服务费		110,078.15	85,468.57
应付交易费用	6.4.7.7	96,186.27	106,883.52
应交税费		32,267.88	36,730.09
应付利息		38,544.80	37,075.13
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	269,264.49	180,000.24
负债合计		181,535,532.14	224,208,401.38
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	598,400,311.36	495,125,027.68
未分配利润	6.4.7.10	92,728,852.46	90,700,602.16
所有者权益合计		691,129,163.82	585,825,629.84
负债和所有者权益总计		872,664,695.96	810,034,031.22

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 598,400,311.36 份，其中 A 类基金份额总额为 362,709,613.31 份，基金份额净值 1.1596 元；C 类基金份额总额为 235,690,698.05 份，基金份额净值 1.1478 元

6.2 利润表

会计主体：太平睿盈混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		35,345,422.70	22,631,266.28
1. 利息收入		10,630,552.35	6,593,366.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,965.61	45,188.93
债券利息收入		10,526,328.54	6,544,598.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		67,258.20	3,578.89
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		34,893,725.86	17,071,706.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	30,560,077.44	10,883,331.54
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13.1	2,858,394.30	5,288,389.29
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,475,254.12	899,985.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,187,985.33	-1,075,334.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	9,129.82	41,527.51
减：二、费用		5,753,987.34	3,551,388.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,995,391.25	1,121,696.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	665,130.40	373,898.77
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	641,306.42	308,983.53
4. 交易费用	6.4.7.19	378,908.17	333,413.56
5. 利息支出		1,934,986.51	1,277,436.57
其中：卖出回购金融资产支出		1,934,986.51	1,277,436.57
6. 税金及附加		21,951.96	20,019.61
7. 其他费用	6.4.7.20	116,312.63	115,940.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,591,435.36	19,079,877.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,591,435.36	19,079,877.65

6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	495,125,027.68	90,700,602.16	585,825,629.84
二、本期经营活	-	29,591,435.36	29,591,435.36

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
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）	103,275,283.68	19,064,872.74	122,340,156.42
其中：1. 基金申购款	114,159,272.82	21,017,132.33	135,176,405.15
2. 基金赎回款	-10,883,989.14	-1,952,259.59	-12,836,248.73
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）	-	-46,628,057.80	-46,628,057.80
五、期末所有者权益（基金净值）	598,400,311.36	92,728,852.46	691,129,163.82
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	-	19,079,877.65	19,079,877.65
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）	13,690,665.55	1,423,280.11	15,113,945.66
其中：1. 基金申购款	49,644,850.01	3,474,249.09	53,119,099.10
2. 基金赎回款	-35,954,184.46	-2,050,968.98	-38,005,153.44
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）	-	-	-

五、期末所有者 权益(基金净值)	375,928,122.30	34,593,459.21	410,521,581.51
---------------------	----------------	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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

6.4 报表附注

6.4.1 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,基金管理人将在履行适当程序后,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 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 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 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况,以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	4,733,137.65
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计	4,733,137.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	122,783,938.12	133,749,161.61	10,965,223.49
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	368,019,253.49	372,424,859.84
	银行间市场	337,189,487.45	334,403,200.00
	合计	705,208,740.94	706,828,059.84
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	827,992,679.06	840,577,221.45	12,584,542.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	558.73
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	1,791.90
应收债券利息	8,354,201.31
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	19.50
合计	8,356,571.44

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	92,414.59
银行间市场应付交易费用	3,771.68
合计	96,186.27

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	4.34
应付证券出借违约金	—
预提信息披露费	179,507.37
预提审计费	89,752.78
合计	269,264.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

太平睿盈混合 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	314,850,788.72	314,850,788.72

本期申购	52,718,697.80	52,718,697.80
本期赎回（以“-”号填列）	-4,859,873.21	-4,859,873.21
-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	362,709,613.31	362,709,613.31

太平睿盈混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	180,274,238.96	180,274,238.96
本期申购	61,440,575.02	61,440,575.02
本期赎回（以“-”号填列）	-6,024,115.93	-6,024,115.93
-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	235,690,698.05	235,690,698.05

注：申购含红利再投份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	40,847,084.10	17,800,934.20	58,648,018.30
本期利润	24,821,270.50	-6,126,102.70	18,695,167.80
本期基金份额 交易产生的变动数	6,232,252.17	2,609,920.71	8,842,172.88
其中：基金申 购款	6,922,574.12	2,865,813.04	9,788,387.16
基金赎 回款	-690,321.95	-255,892.33	-946,214.28
本期已分配利 润	-28,288,547.17	-	-28,288,547.17
本期末	43,612,059.60	14,284,752.21	57,896,811.81

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	22,534,778.68	9,517,805.18	32,052,583.86
本期利润	14,958,150.19	-4,061,882.63	10,896,267.56

本期基金份额 交易产生的变动数	7,247,654.55	2,975,045.31	10,222,699.86
其中：基金申 购款	8,017,151.37	3,211,593.80	11,228,745.17
基金赎回款	-769,496.82	-236,548.49	-1,006,045.31
本期已分配利 润	-18,339,510.63	-	-18,339,510.63
本期末	26,401,072.79	8,430,967.86	34,832,040.65

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,019.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	18,468.89
其他	477.70
合计	36,965.61

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	139,225,535.98
减：卖出股票成本总额	108,665,458.54
买卖股票差价收入	30,560,077.44

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	305,079,103.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	298,605,518.75
减：应收利息总额	3,615,189.95
买卖债券差价收入	2,858,394.30

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,475,254.12
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	1,475,254.12

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-10,187,985.33
股票投资	-16,728,510.53
债券投资	6,540,525.20
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	-10,187,985.33

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,124.37
基金转换费收入	5.45
合计	9,129.82

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，基金转换费用由基金持有人承担。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	376,433.17
银行间市场交易费用	2,475.00
合计	378,908.17

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行划款手续费	8,452.48
银行间账户维护费	18,600.00
合计	116,312.63

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
太平基金管理有限公司（“太平基金”）	基金管理人、基金销售机构、登记机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,995,391.25	1,121,696.13
其中：支付销售机构的客户维护费	140,303.90	44,838.30

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	665,130.40	373,898.77

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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
太平基金管理有限公司	-	503,949.64	503,949.64
合计	-	503,949.64	503,949.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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
太平基金管理有限公司	0.00	265,677.45	265,677.45
合计	0.00	265,677.45	265,677.45

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

本基金报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人于本报告期内及上年度可比期间内未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

于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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,733,137.65	18,019.02	4,810,559.22	38,693.35

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金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。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

太平睿盈混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 4 月 20 日	-	2021 年 4 月 20 日	0.8000	17,137,716.37	11,150,830.80	28,288,547.17	-
合计	-	-	-	0.8000	17,137,716.37	11,150,830.80	28,288,547.17	-
太平睿盈混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 4 月 20 日	-	2021 年 4 月 20 日	0.8000	14,806,672.04	3,532,838.59	18,339,510.63	-
合计	-	-	-	0.8000	14,806,672.04	3,532,838.59	18,339,510.63	-

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 07 月 21 日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021年6月4日	2021年8月25日	新股锁定	0.00	27.42	108	0.00	2,961.36	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林	2021	2021	新股锁	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-

	精密	年 4 月 6 日	年 10 月 15 日	定						
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定	33.22	87.50	911	30,263.42	79,712.50	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁定	48.59	90.39	588	28,570.92	53,149.32	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 01 日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益	2021	2021	新股锁	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

	通	年 5 月 12 日	年 11 月 22 日	定						
300992	泰福 泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马 遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股锁 定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德 新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐 家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波 方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛 股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁 定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益 股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股锁 定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈 仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁 定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠 股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁 定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪 节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁 定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立 科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁 定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688316	青云科技	2021年3月5日	2021年9月16日	新股锁定	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688395	正弦电气	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688565	力源科技	2021年5月6日	2021年11月15日	新股锁定	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-

			日							
688659	元琛科技	2021年3月24日	2021年9月30日	新股锁定	6.50	10.46	3,671	23,861.50	38,398.66	-
688676	金盘科技	2021年3月2日	2021年9月9日	新股锁定	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688700	东威科技	2021年6月7日	2021年12月15日	新股锁定	9.41	38.46	3,049	28,691.09	117,264.54	-

6.4.12.1.2 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 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	11,990	1,199,000.00	1,199,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	230	23,000.00	23,000.00	-
113626	伯特转债	2021年6月30日	2021年7月21日	新债未上市	100.00	100.00	660	66,000.00	66,000.00	-
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	新债未上市	100.00	100.00	240	24,000.00	24,000.00	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 164,747,000.00 元,截至 2021 年 12 月 24 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金,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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	10,004,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	35,010,500.00	29,826,000.00
合计	45,014,500.00	29,826,000.00

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末及上年度末，基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

截至本报告期末及上年度末，基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	523,868,641.50	515,096,234.10
AAA 以下	132,788,767.14	56,552,729.10
未评级	5,156,151.20	31,671,452.20
合计	661,813,559.84	603,320,415.40

注：未评级债券为地方政府债和政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末及上年度末，基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

截至本报告期末及上年度末，基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

理的价格变现。

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

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 164,747,000.00 元将在六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约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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,733,137.65	-	-	-	4,733,137.65
结算备付金	3,982,112.74	-	-	-	3,982,112.74
存出保证金	43,430.67	-	-	-	43,430.67
交易性金融资产	361,753,232.94	345,074,826.90	-	133,749,161.61	840,577,221.45
应收利息	-	-	-	8,356,571.44	8,356,571.44
应收申购款	-	-	-	63,836.81	63,836.81
应收证券清算款	-	-	-	14,908,385.20	14,908,385.20
资产总计	370,511,914.00	345,074,826.90	-	157,077,955.06	872,664,695.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	79,021.03	79,021.03
应付管理人报酬	-	-	-	337,873.84	337,873.84
应付托管费	-	-	-	112,624.61	112,624.61

应付证券清算款	-	-	-	15,712,671.07	15,712,671.07
卖出回购金融资产款	164,747,000.00	-	-	-	164,747,000.00
应付销售服务费	-	-	-	110,078.15	110,078.15
应付交易费用	-	-	-	96,186.27	96,186.27
应付利息	-	-	-	38,544.80	38,544.80
应交税费	-	-	-	32,267.88	32,267.88
其他负债	-	-	-	269,264.49	269,264.49
负债总计	164,747,000.00	-	-	16,788,532.14	181,535,532.14
利率敏感度缺口	205,764,914.00	345,074,826.90	-	140,289,422.92	691,129,163.82
上年度末 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

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	4,877,084.46	4,553,870.83
	市场利率上升 25 个基点	-4,814,898.39	-4,491,534.41

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	133,749,161.61	19.35	133,619,050.46	22.81
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	133,749,161.61	19.35	133,619,050.46	22.81

6.4.13.4.3.2 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	—	6,563,723.62
	沪深 300 指数下降 5%	—	-6,563,723.62

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 19.35% 因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	133,749,161.61	15.33

	其中：股票	133,749,161.61	15.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	706,828,059.84	81.00
	其中：债券	706,828,059.84	81.00
	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	8,715,250.39	1.00
8	其他各项资产	23,372,224.12	2.68
9	合计	872,664,695.96	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	80,818,963.11	11.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,407,678.21	1.94
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,707,000.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,460,194.21	0.65
J	金融业	29,644,021.10	4.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,558,000.00	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	70,238.75	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	133,749,161.61	19.35

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600900	长江电力	400,000	8,256,000.00	1.19
2	300298	三诺生物	259,959	8,141,915.88	1.18
3	002050	三花智控	300,813	7,213,495.74	1.04
4	600885	宏发股份	100,000	6,270,000.00	0.91
5	600519	贵州茅台	3,000	6,170,100.00	0.89
6	000001	平安银行	250,000	5,655,000.00	0.82
7	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.74
8	000895	双汇发展	160,000	5,088,000.00	0.74
9	000333	美的集团	70,000	4,995,900.00	0.72
10	601318	中国平安	70,000	4,499,600.00	0.65
11	000338	潍柴动力	250,000	4,467,500.00	0.65
12	300124	汇川技术	60,000	4,455,600.00	0.64
13	002142	宁波银行	110,000	4,286,700.00	0.62
14	300059	东方财富	130,000	4,262,700.00	0.62
15	002475	立讯精密	90,000	4,140,000.00	0.60
16	601166	兴业银行	200,000	4,110,000.00	0.59
17	600887	伊利股份	100,000	3,683,000.00	0.53
18	300676	华大基因	30,000	3,558,000.00	0.51
19	600309	万华化学	30,000	3,264,600.00	0.47
20	601336	新华保险	70,000	3,213,700.00	0.46
21	002304	洋河股份	15,000	3,108,000.00	0.45
22	603806	福斯特	24,000	2,523,120.00	0.37
23	300760	迈瑞医疗	5,000	2,400,250.00	0.35
24	688111	金山办公	6,000	2,368,800.00	0.34
25	601601	中国太保	80,000	2,317,600.00	0.34
26	600690	海尔智家	80,000	2,072,800.00	0.30
27	600276	恒瑞医药	30,000	2,039,100.00	0.30
28	603195	公牛集团	10,000	2,020,000.00	0.29
29	688158	优刻得	50,000	1,962,500.00	0.28
30	601021	春秋航空	30,000	1,707,000.00	0.25
31	300408	三环集团	40,000	1,696,800.00	0.25
32	600585	海螺水泥	40,000	1,642,000.00	0.24
33	300258	精锻科技	100,000	1,337,000.00	0.19
34	601838	成都银行	100,000	1,264,000.00	0.18
35	600600	青岛啤酒	10,000	1,156,500.00	0.17

36	603596	伯特利	30,000	1,072,500.00	0.16
37	000723	美锦能源	100,000	756,000.00	0.11
38	688700	东威科技	3,049	117,264.54	0.02
39	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
40	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.01
41	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
42	300979	华利集团	911	79,712.50	0.01
43	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.01
44	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
45	300981	中红医疗	588	53,149.32	0.01
46	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
47	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
48	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
49	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.01
50	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
51	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
52	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
53	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
54	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
55	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
56	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
57	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
58	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
59	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
60	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
61	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
62	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
63	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
64	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
65	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
66	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
67	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
68	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
69	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
70	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
71	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
72	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
73	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
74	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
75	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
76	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
77	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00

78	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
79	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
80	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
81	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
82	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
83	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
84	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
85	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
86	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
87	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
88	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
89	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
90	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
91	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
92	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
93	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
94	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
95	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
96	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
97	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
98	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
99	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
100	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
101	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
102	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
103	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
104	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
105	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	5,686,841.00	0.97
2	000338	潍柴动力	5,373,954.00	0.92
3	002050	三花智控	4,972,679.70	0.85
4	601398	工商银行	4,459,805.00	0.76
5	000895	双汇发展	4,378,893.00	0.75
6	601166	兴业银行	4,261,422.00	0.73
7	300298	三诺生物	4,066,440.84	0.69
8	002475	立讯精密	3,768,022.00	0.64
9	000429	粤高速 A	3,740,887.00	0.64

10	601336	新华保险	3,698,427.00	0.63
11	300676	华大基因	3,578,973.00	0.61
12	688111	金山办公	3,577,750.00	0.61
13	300124	汇川技术	3,530,631.00	0.60
14	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.59
15	601601	中国太保	3,386,013.00	0.58
16	600926	杭州银行	3,297,651.00	0.56
17	600885	宏发股份	3,169,100.00	0.54
18	300059	东方财富	2,793,905.00	0.48
19	300567	精测电子	2,575,154.00	0.44
20	600276	恒瑞医药	2,491,418.60	0.43

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	5,932,600.61	1.01
2	000002	万科A	5,907,395.62	1.01
3	600031	三一重工	5,315,830.00	0.91
4	000651	格力电器	5,121,601.00	0.87
5	300059	东方财富	5,114,931.08	0.87
6	600377	XD 宁沪高	4,585,788.00	0.78
7	300274	阳光电源	4,514,893.00	0.77
8	002601	龙佰集团	4,405,435.00	0.75
9	601398	工商银行	4,168,000.00	0.71
10	300567	精测电子	3,873,074.00	0.66
11	300750	宁德时代	3,607,144.00	0.62
12	000429	粤高速A	3,570,567.00	0.61
13	600176	中国巨石	3,468,027.00	0.59
14	002332	仙琚制药	3,314,819.00	0.57
15	600926	杭州银行	3,298,047.00	0.56
16	600009	上海机场	3,236,938.00	0.55
17	300450	先导智能	3,083,281.00	0.53
18	603187	海容冷链	2,970,696.00	0.51
19	600690	海尔智家	2,942,574.80	0.50
20	600104	上汽集团	2,821,594.00	0.48

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	125,524,080.22
卖出股票收入（成交）总额	139,225,535.98

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	35,010,500.00	5.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	236,956,038.40	34.29
	其中：政策性金融债	5,148,038.40	0.74
4	企业债券	70,758,000.00	10.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	242,845,200.00	35.14
7	可转债（可交换债）	121,235,016.54	17.54
8	同业存单	-	-
9	其他	23,304.90	0.00
10	合计	706,828,059.84	102.27

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	175272	20 银河 G2	400,000	40,364,000.00	5.84
2	155287	19 平证 03	400,000	40,248,000.00	5.82
3	019654	21 国债 06	350,000	35,010,500.00	5.07
4	112729	18 申宏 02	300,000	30,906,000.00	4.47
5	1723002	17 平安财险	300,000	30,840,000.00	4.46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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、处罚的情况

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安证券股份有限公司、长江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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	43,430.67
2	应收证券清算款	14,908,385.20
3	应收股利	—
4	应收利息	8,356,571.44
5	应收申购款	63,836.81
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	23,372,224.12

7.12.4 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	127027	靖远转债	8,855,540.80	1.28
2	128107	交科转债	6,865,985.76	0.99
3	123076	强力转债	6,759,500.44	0.98
4	128130	景兴转债	6,550,512.07	0.95
5	110056	亨通转债	5,984,297.10	0.87

6	123071	天能转债	5,661,389.25	0.82
7	128081	海亮转债	5,620,799.01	0.81
8	113602	景 20 转债	4,620,153.00	0.67
9	128124	科华转债	4,376,679.30	0.63
10	127012	招路转债	4,281,200.00	0.62
11	113009	广汽转债	4,260,173.70	0.62
12	110063	鹰 19 转债	2,949,750.00	0.43
13	128125	华阳转债	2,669,196.00	0.39
14	113610	灵康转债	2,481,010.00	0.36
15	113014	林洋转债	2,458,512.00	0.36
16	127016	鲁泰转债	2,136,000.00	0.31
17	113528	长城转债	1,921,112.60	0.28
18	113017	吉视转债	1,784,493.60	0.26
19	113026	核能转债	1,691,680.00	0.24
20	123049	维尔转债	1,634,079.00	0.24
21	132011	17 浙报 EB	1,472,325.00	0.21
22	128071	合兴转债	1,471,447.12	0.21
23	127014	北方转债	1,454,180.00	0.21
24	128136	立讯转债	1,169,500.00	0.17
25	110057	现代转债	1,116,981.90	0.16
26	110067	华安转债	1,090,313.00	0.16
27	128122	兴森转债	929,351.00	0.13
28	123075	贝斯转债	927,047.05	0.13
29	113505	杭电转债	820,526.20	0.12
30	128138	侨银转债	670,862.50	0.10
31	110051	中天转债	620,082.00	0.09
32	113044	大秦转债	543,364.80	0.08
33	128018	时达转债	342,390.00	0.05
34	123086	海兰转债	332,400.00	0.05
35	128105	长集转债	325,020.00	0.05
36	113601	塞力转债	304,410.00	0.04
37	128140	润建转债	98,661.84	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.74	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
太平睿盈混合 A	403	900,023.85	355,410,801.03	97.9877	7,298,812.28	2.0123
太平睿盈混合 C	4,333	54,394.35	220,435,583.29	93.5275	15,255,114.76	6.4725
合计	4,710	127,048.90	575,846,384.32	96.2310	22,553,927.04	3.7690

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。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	太平睿盈混合 A	462,837.92	0.1276
	太平睿盈混合 C	1,050,251.60	0.4456
	合计	1,513,089.52	0.2529

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	—
	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	-
	太平睿盈混合 C	-
	合计	-

§ 9 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 (2019 年 3 月 25 日) 基金份额总额	229,947,908.95	-
本报告期期初基金份 额总额	314,850,788.72	180,274,238.96
本报告期基金总申购 份额	52,718,697.80	61,440,575.02
减：本报告期基金总 赎回份额	4,859,873.21	6,024,115.93
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	362,709,613.31	235,690,698.05

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况

本报告期，基金管理人无重大人事变动情况。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券股份有限公司	2	252,377,405.88	100.00%	182,168.62	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

海通证券股份有限公司	413,665,724.14	100.00%	2,449,063,000.00	100.00%	-	-
------------	----------------	---------	------------------	---------	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加阳光人寿保险股份有限公司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	2021 年 06 月 22 日
2	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司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	2021 年 06 月 24 日
3	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	2021 年 01 月 26 日
4	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	2021 年 02 月 01 日
5	太平睿盈混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 02 月 09 日
6	太平睿盈混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 20 日
7	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	2021 年 04 月 19 日
8	太平睿盈混合型证券投资基金 2020 年年度报告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 03 月 25 日
9	太平睿盈混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 01 月 22 日
10	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	2021 年 01 月 29 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	2021 年 02 月 05 日
12	太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 1 号	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 02 月 09 日
13	太平睿盈混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 22 日
14	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加民商基金销售（上海）有限公司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	2021 年 04 月 14 日
15	太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 2 号	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 20 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101-20210103	202,329,173.18	-	202,329,173.18	-	-
机构	2	20210104-20210630	-	202,329,173.18	-	202,329,173.18	33.8117
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险,甚至引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：本章节中申购份额/赎回份额统计包含非交易过户业务。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可

在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日