

太平睿盈混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 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 2022 年 8 月 29 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 2022 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	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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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等内容的真实、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 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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	54
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 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	508,892,311.79 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	405,183,810.47 份	103,708,501.32 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×80%+沪深 300 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

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
	联系电话	021-38556613
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund. com. cn
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 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	焦艳军	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(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	太平睿盈混合 A	太平睿盈混合 C
本期已实现收益	-18,675,104.52	-10,167,038.60
本期利润	-31,382,442.61	-22,412,537.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0706	-0.1003
本期加权平均净值利润率	-6.58%	-9.46%
本期基金份额净值增长率	-5.40%	-5.62%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	17,484,570.50	3,029,308.84
期末可供分配基金份额利润	0.0432	0.0292

期末基金资产净值	439,584,207.88	110,683,678.99
期末基金份额净值	1.0849	1.0673
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	35.01%	30.62%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

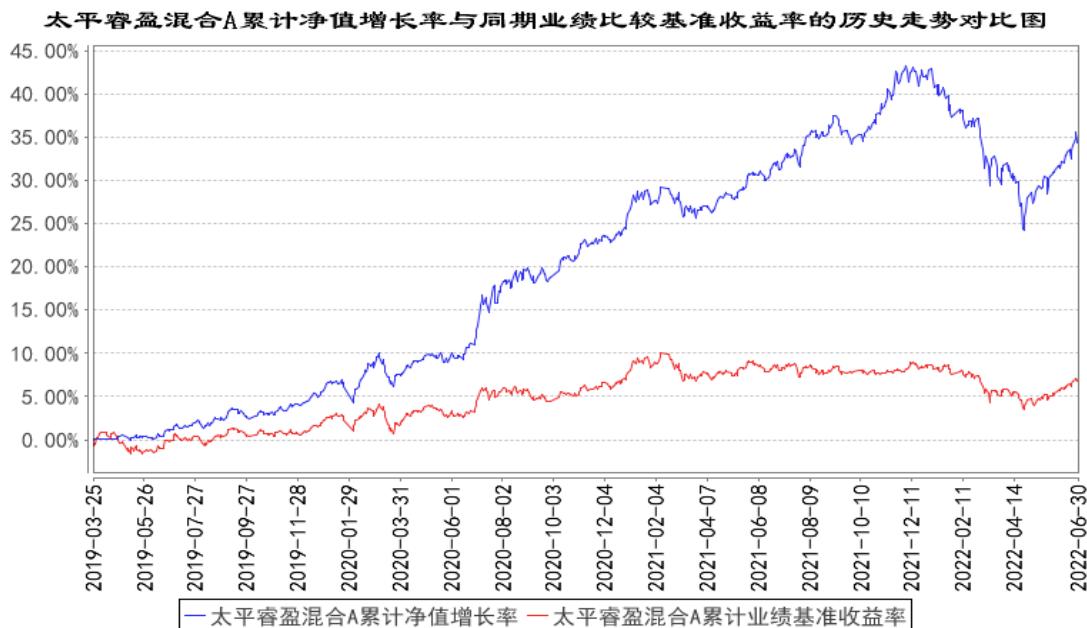
太平睿盈混合 A

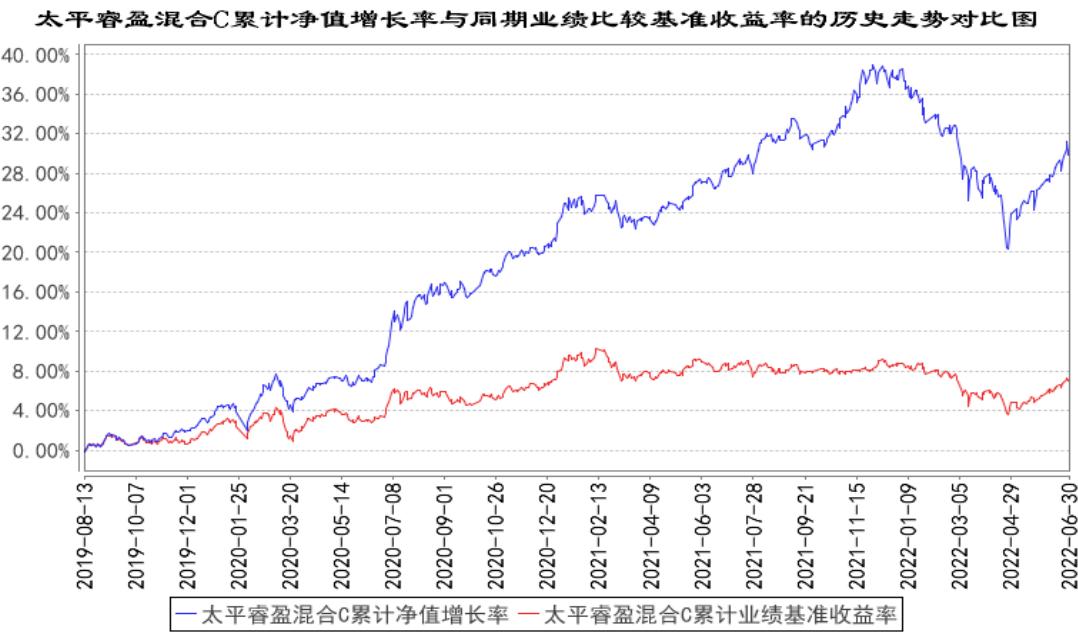
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.06%	0.44%	1.68%	0.21%	1.38%	0.23%
过去三个月	3.01%	0.64%	1.55%	0.28%	1.46%	0.36%
过去六个月	-5.40%	0.64%	-1.42%	0.29%	-3.98%	0.35%
过去一年	2.27%	0.53%	-1.29%	0.25%	3.56%	0.28%
过去三年	33.37%	0.41%	7.16%	0.25%	26.21%	0.16%
自基金合同生效起至今	35.01%	0.39%	7.14%	0.25%	27.87%	0.14%

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
过去一个月	3. 02%	0. 44%	1. 68%	0. 21%	1. 34%	0. 23%
过去三个月	2. 88%	0. 64%	1. 55%	0. 28%	1. 33%	0. 36%
过去六个月	-5. 62%	0. 64%	-1. 42%	0. 29%	-4. 20%	0. 35%
过去一年	1. 76%	0. 52%	-1. 29%	0. 25%	3. 05%	0. 27%
自基金合同生效起至今	30. 62%	0. 42%	7. 30%	0. 25%	23. 32%	0. 17%

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





注：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 25 日，本基金建仓期为自基金合同生效起六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示 1 日期为 2019 年 3 月 25 日至 2022 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 2022 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。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 28 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、太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金、太平睿享混合型证券投资基金、太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平恒兴纯债债券型证券投资基金、太平睿庆混合型证券投资基金、太平中证 1000 指数增强型证券投资基金、太平安元债券型证券投资基金、太平嘉和三个月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	2019 年 3 月 25 日	-	9 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。2021 年 9 月 17 日起担任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。

	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、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、太平睿享混合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、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、太平睿享混	2019年3月29日	-	11年	南开大学精算学专业经济学硕士。2010年7月加入光大保德信基金管理有限公司，历任投资部研究助理、固定收益研究员、固定收益高级研究员。2014年1月先后担任光大保德信增利收益债券型证券投资基金经理、光大保德信信用添益债券型证券投资基金管理人、光大保德信安和债券型证券投资基金管理人、光大保德信安祺债券型证券投资基金管理人、光大保德信安诚债券型证券投资基金管理人、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金管理人、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金管理人。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。2021

	合型证券投资基金基金经理、太平睿庆混合型证券投资基金基金经理、太平安元债券型证券投资基金基金经理				年9月17日起担任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。2021年12月21日起担任太平睿庆混合型证券投资基金基金经理。2022年5月5日起担任太平安元债券型证券投资基金基金经理。
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	-	5年	上海交通大学工程硕士，具有证券投资基金管理从业资格。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。
苏大明	本基金的基金经理助理、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助理、太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理	2021年9月24日	-	10年	格罗宁根大学金融学硕士，具有证券投资基金管理从业资格。2012年起先后在大公国际资信评估有限公司、长江养老保险股份有限公司从事信用评估研究相关工作。2016年4月加入本公司，从事投资研究及管理工作。2021年9月24日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理助理。2021年9月24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助理。2021年9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助理。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期一般情况下根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；
 2、证券基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

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 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如 1 日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年经济经历了持续的波动，第一季度经济开局良好，第二季度经济经受了新一轮疫情的影响，同时国外包括俄乌冲突、国外通胀大幅飙升、美联储加息缩表等等超预期的因素对国内经济和资本市场都造成一定的扰动。随着相关信息和因素经过释放和确定后，4 月底以来权益市场出现明显改善，债券市场受益于市场流动性宽松环境而逐步改善。本报告期内，本基金在维持相对较高的股票仓位，风格整体保持均衡，转债部分 4-5 月加仓。纯债方面主要以中短久期高等级信用债套息为主。整体组合仍然通过股债平衡的思路进行仓位管理，利用动态的仓位调整力求控制回撤，积极捕捉市场机会，力求为投资人取得收益。

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 -5.40%，同期业绩比较基准收益率为 -1.42%。太平睿盈 C 的份额净值增长率为 -5.62%，同期业绩比较基准收益率为 -1.42%。

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，疫情防控逐渐取得成效，各地复工复产有序推进，预计此前受到影响的线下消费活动将修复。整体从高频数据显示生产端的修复明显领先于需求端，随着供应链、物流以及相关政策的改善，预计三季度需求端也将环比改善。权益市场往后展望，关注制造业中汽车及零部件、机械设备、电子和通信制造行业，以及疫情后消费复苏改善的食品饮料、交运物流、地产后周期的家电家具等行业，还有政策一直大力支持且景气度较高的光伏风电、国防军工板块。债券市场资金面持续保持宽松状态，收益率曲线基本保持平稳。后续需要关注各项政策的宽信用效果如何，从而决定经济增速修复的强度来确定债券收益率的空间。

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》、《证券投资基金管理核算业务指引》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。公司估值与产品委员会下设估值分委会，常任委员由稽核风控部、投资部门、研究部、基金运营部等部门负责人担任。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及《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%。

本基金管理人在本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

本年度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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6. 4. 7. 1	16,859,398.37	6,236,754.53
结算备付金		1,207,496.32	4,588,529.62
存出保证金		160,550.29	105,858.45
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	566,781,434.63	1,045,452,142.67
其中：股票投资		163,270,842.26	253,214,066.70
基金投资		-	-
债券投资		393,150,614.60	775,656,375.97
资产支持证券投资		10,359,977.77	16,581,700.00
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	25,000,000.00	-
债权投资	6. 4. 7. 5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6. 4. 7. 6	-	-
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	-	-
应收清算款		8,968,165.64	10,487,839.28
应收股利		-	-
应收申购款		57,007.41	533,610.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	10,001,865.34
资产总计		619,034,052.66	1,077,406,600.86
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		49,019,945.74	194,374,000.00
应付清算款		18,393,257.95	10,319,666.79
应付赎回款		326,462.08	1,624,302.55
应付管理人报酬		284,612.42	438,718.64
应付托管费		94,870.78	146,239.56
应付销售服务费		56,287.85	140,516.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		18,411.19	27,505.33
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	572,317.78	851,917.28
负债合计		68,766,165.79	207,922,866.34
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 10	508,892,311.79	762,200,682.22
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	41,375,575.08	107,283,052.30
净资产合计		550,267,886.87	869,483,734.52
负债和净资产总计		619,034,052.66	1,077,406,600.86

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 508,892,311.79 份，其中 A 类基金份额总额为 405,183,810.47 份，基金份额净值 1.0849 元；C 类基金份额总额为 103,708,501.32 份，基金份额净值 1.0673 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至2022年 6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
一、营业总收入		-48,911,797.78	35,345,422.70
1. 利息收入		117,556.38	10,630,552.35
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	52,080.69	36,965.61
债券利息收入		-	10,526,328.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		65,475.69	67,258.20
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		-24,338,146.89	34,893,725.86
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	-44,251,755.59	30,560,077.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	17,191,257.23	2,858,394.30
资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 16	210,736.64	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	-	-
股利收益	6. 4. 7. 19	2,511,614.83	1,475,254.12
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	-24,952,837.10	-10,187,985.33
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. 21	261,629.83	9,129.82
减：二、营业总支出		4,883,182.44	5,753,987.34
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2,139,998.80	1,995,391.25
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	713,332.89	665,130.40
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	594,668.16	641,306.42
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,312,346.06	1,934,986.51
其中：卖出回购金融资产支出		1,312,346.06	1,934,986.51
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		14,942.06	21,951.96
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	107,894.47	495,220.80

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-53,794,980.22	29,591,435.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-53,794,980.22	29,591,435.36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-53,794,980.22	29,591,435.36

6.3 净资产（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：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金份额)	762,200,682.22	-	107,283,052.30	869,483,734.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金份额)	762,200,682.22	-	107,283,052.30	869,483,734.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-253,308,370.43	-	-65,907,477.22	-319,215,847.65
(一)、综合收益总额	-	-	-53,794,980.22	-53,794,980.22
(二)、本期基金份额交易产	-253,308,370.43	-	-12,112,497.00	-265,420,867.43

生的基 金净值 变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	86,412,608.90	-	7,178,609.41	93,591,218.31
2 .基金赎 回款	-339,720,979.33	-	-19,291,106.41	-359,012,085.74
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	508,892,311.79	-	41,375,575.08	550,267,886.87
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	495,125,027.68	-	90,700,602.16	585,825,629.84
加:会计 政策变 更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	495,125,027.68	-	90,700,602.16	585,825,629.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	103,275,283.68	-	2,028,250.30	105,303,533.98
(一)、综合收益总额	-	-	29,591,435.36	29,591,435.36
(二)、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
(三)、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“-”)	-	-	-46,628,057.80	-46,628,057.80

号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	598,400,311.36	-	92,728,852.46	691,129,163.82

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>范宇</u>	<u>史彦刚</u>	<u>王瑞瑾</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×80%+沪深 300 指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量

(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《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>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类: (1)以摊余成本计量的金融资产; (2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产; 及(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下,金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则,嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险,因此在新金融工具准则下,本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定,对新金融工具准则施行日(即 2022 年 1 月 1 日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据,将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

执行新金融工具准则对本基金资产负债表的影响汇总如下:

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日,本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、【结算备付金、】【存出保证金、】【买入返售金融资产、】【应收证券清算款、】应收利息、【应收股利、】【应收申购款】【和其他资产】,对应的账面价值分别为人民币 6,236,754.53 元、

【4,588,529.62 元、】【105,858.45 元、】【0 元、】【10,487,839.28 元、】10,001,865.34 元、
【0 元、】【533,610.97 元】和【0 元】。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款【结算备付金、】【存出保证金、】【买入返售金融资产、】【应收证券清算款、】【应收股利、】【应收申购款】【和其他资产】，对应的账面价值分别为人民币 6,238,255.37 元、【4,590,800.90 元、】
【105,910.81 元、】【0 元、】【10,487,839.28 元、】【0 元、】【533,610.97 元】和【0 元】。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产【和衍生金融资产】，对应的账面价值【分别】为人民币
1,045,452,142.67 元【和 0 元】。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产【和衍生金融资产】对应的账面价值【分别】为人民币 1,055,450,183.53
元【和 0 元】。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为【卖出回购金融资产款、】【应付证券清算款、】【应付赎回款、】应付管理人报酬、应付托管费、【应付销售服务费、】【应付交易费用、】【应交税费、】应付利息【和其他负债】，对应的账面价值分别为人民币【194,374,000.00 元、】10,319,666.79 元、【1,624,302.55 元、】438,718.64 元、146,239.56
元、【140,516.19 元、】378,636.15 元、【27,505.33 元、】192,863.73 元【和 280,417.40
元】。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为【卖出回购金融资产款、】【应付证券清算款、】【应付赎回款、】应付管理人报酬、应付托管费、【应付销售服务费、】【应交税费、】【和其他负债】，对应的账面价值分别为人民币【194,566,863.73 元、】
【10,319,666.79 元、】【1,624,302.55 元、】438,718.64 元、146,239.56 元、【140,516.19 元、】
【27,505.33 元、】【和 659,053.55 元】。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下
列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2022年6月30日
活期存款	16,859,398.37
等于：本金	16,858,770.87
加：应计利息	627.50
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	16,859,398.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	162,374,291.98	-	163,270,842.26	896,550.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	332,505,071.53	2,296,311.72	335,708,263.09
	银行间市场	56,016,724.14	986,251.51	57,442,351.51
	合计	388,521,795.67	3,282,563.23	393,150,614.60
资产支持证券	10,323,000.00	27,077.77	10,359,977.77	9,900.00
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	561,219,087.65	3,309,641.00	566,781,434.63	2,252,705.98

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	25,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	25,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金于本报告期末无按预期信用损失一般模型计提的减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	251.39
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	252,723.23
其中：交易所市场	251,589.16
银行间市场	1,134.07
应付利息	-
预提信息披露费	299,507.37
预提审计费	19,835.79
合计	572,317.78

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

太平睿盈混合 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	472,480,163.55	472,480,163.55
本期申购	55,038,239.64	55,038,239.64
本期赎回(以“-”号填列)	-122,334,592.72	-122,334,592.72
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	405,183,810.47	405,183,810.47

太平睿盈混合 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	289,720,518.67	289,720,518.67
本期申购	31,374,369.26	31,374,369.26
本期赎回(以“-”号填列)	-217,386,386.61	-217,386,386.61
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	103,708,501.32	103,708,501.32

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 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
本期期初	40,736,778.84	28,612,420.05	69,349,198.89
本期利润	-18,675,104.52	-12,707,338.09	-31,382,442.61
本期基金份额交易产生的变动数	-4,577,103.82	1,010,744.95	-3,566,358.87
其中：基金申购款	5,065,326.27	1,491,353.78	6,556,680.05
基金赎回款	-9,642,430.09	-480,608.83	-10,123,038.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,484,570.50	16,915,826.91	34,400,397.41

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
本期期初	21,511,550.78	16,422,302.63	37,933,853.41
本期利润	-10,167,038.60	-12,245,499.01	-22,412,537.61
本期基金份额交易产生的变动数	-8,315,203.34	-230,934.79	-8,546,138.13
其中：基金申购款	1,725,621.72	-1,103,692.36	621,929.36
基金赎回款	-10,040,825.06	872,757.57	-9,168,067.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,029,308.84	3,945,868.83	6,975,177.67

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	22,186.15
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	28,498.61
其他	1,395.93
合计	52,080.69

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日

股票投资收益——买卖股票差价收入	-44,251,755.59
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-44,251,755.59

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	450,183,138.34
减：卖出股票成本总额	493,257,085.14
减：交易费用	1,177,808.79
买卖股票差价收入	-44,251,755.59

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	7,958,745.98
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	9,232,511.25
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	17,191,257.23

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	716,757,953.59
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	699,581,064.95
减：应计利息总额	7,931,452.09
减：交易费用	12,925.30
买卖债券差价收入	9,232,511.25

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	210,736.64
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	0.00
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	210,736.64

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	6,446,451.23
减：卖出资产支持证券成本总额	6,251,400.00
减：应计利息总额	195,051.23
减：交易费用	0.00
资产支持证券投资收益	0.00

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,511,614.83

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	2,511,614.83

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-24,952,837.10
股票投资	-9,949,727.51
债券投资	-15,005,709.59
资产支持证券投资	2,600.00
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	-24,952,837.10

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	261,551.44
基金转换费收入	78.39
合计	261,629.83

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。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	10,101.31

账户维护费	18,450.00
合计	107,894.47

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

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

于 2022 年 1 月，经本基金的基金管理人太平基金股东会决议通过，并根据中国证监会批复核准(证监许可[2021]4051 号)，太平人寿保险有限公司认缴太平基金新增注册资本，增资事项完成后，太平资产管理有限公司、太平人寿保险有限公司及安石投资管理有限公司对太平基金的持股比例分别变更为 56.31%、38.46%、5.23%。上述事项的工商变更登记已于 2022 年 1 月 27 日办理完毕。

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(以下简称“太平基金”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金托管人
太平人寿保险有限公司(以下简称“太平人寿”)	基金管理人的股东

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,139,998.80	1,995,391.25
其中：支付销售机构的客户维护费	211,642.42	140,303.90

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	713,332.89	665,130.40

注：支付基金托管行招商银行的基金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。计算公式为：日基金托管费=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 2022年1月1日至2022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	-	421,929.18	421,929.18
合计	-	421,929.18	421,929.18
获得销售服务费的各关联 方名称	上年度可比期间 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

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 $\times 0.50\% / \text{当年天数}$ 。

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

基金管理人于报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

太平睿盈混合 A

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
太平人寿保险股份有限公司	244,316,912.51	60.2978	-	-

份额单位：份

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	16,859,398.37	22,186.15	4,733,137.65	18,019.02

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022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	受限期	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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	锁定期股票	55.57	30.03	614	34,119.98	18,438.42	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	锁定期股票	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	锁定期股票	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	锁定期股票	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	锁定期股票	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	锁定期股票	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	锁定期股票	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	锁定期股票	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	锁定期股票	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-

		日									
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	锁定期股票	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	锁定期股票	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-	-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	锁定期股票	163.56	82.76	249	27,150.96	20,607.24	-	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	锁定期股票	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	锁定期股票	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	锁定期股票	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	锁定期股票	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	锁定期股票	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	锁定期股票	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	锁定期股票	35.68	29.84	943	33,646.24	28,139.12	-	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	锁定期股票	173.98	87.82	238	22,965.36	20,901.16	-	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	锁定期股票	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-	-
301233	盛帮	2022年6月	6个月	锁定期	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-	-

	股份	6月24日		股票						
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	锁定期股票	19.18	32.07	2,051	39,338.18	65,775.57	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	锁定期股票	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	锁定期股票	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	锁定期股票	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	锁定期股票	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	锁定期股票	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	锁定期股票	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	锁定期股票	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	锁定期股票	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	锁定期股票	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	锁定期股票	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	锁定期股票	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	锁定期股票	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-

688047	龙芯中科	2022年6月17日	6个月	锁定期股票	60.06	82.01	4,636	278,438.16	380,198.36	-
688150	莱特光电	2022年3月10日	6个月	锁定期股票	22.05	19.60	5,626	124,053.30	110,269.60	-
688223	晶科能源	2022年1月19日	6个月	锁定期股票	5.00	14.47	106,500	532,500.00	1,541,055.00	-
688259	创耀科技	2022年1月5日	6个月	锁定期股票	66.60	79.22	1,595	106,227.00	126,355.90	-
688322	奥比中光	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	8,332	258,208.68	258,208.68	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	9,403	206,207.79	206,207.79	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

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

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 49,019,945.74 元，于 2022 年 7 月 4 日、7 月 11 日、8 月 15 日、8 月 22 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，属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。本基金的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风险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。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,573,082.19	45,937,800.00
合计	30,573,082.19	45,937,800.00

注：未评级债券为政策性金融债。

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。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	208,346,399.80	497,084,832.52
AAA 以下	149,119,622.62	232,625,675.45
未评级	5,111,509.99	8,068.00
合计	362,577,532.41	729,718,575.97

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	10,359,977.77	16,581,700.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	10,359,977.77	16,581,700.00

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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 49,019,945.74 元将在六个月内到期且计息(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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 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 2022 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。

综合上述各类流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好，无重大流动性风险。

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、存在保证金和卖出回购金融资产等利率敏感性资产，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 2022年6月30日	1年内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,859,398.37	-	-	-	16,859,398.37
结算备付金	1,207,496.32	-	-	-	1,207,496.32
存出保证金	160,550.29	-	-	-	160,550.29
交易性金融资产	246,825,361.12	104,453,124.40	52,232,106.85	163,270,842.26	566,781,434.63
买入返售金融资产	25,000,000.00	-	-	-	25,000,000.00
应收申购款	-	-	-	57,007.41	57,007.41
应收清算款	-	-	-	8,968,165.64	8,968,165.64
资产总计	290,052,806.10	104,453,124.40	52,232,106.85	172,296,015.31	619,034,052.66
负债					

应付赎回款	-	-	-	326,462.08	326,462.08
应付管理人报酬	-	-	-	284,612.42	284,612.42
应付托管费	-	-	-	94,870.78	94,870.78
应付清算款	-	-	-	18,393,257.95	18,393,257.95
卖出回购金融资产款	49,019,945.74	-	-	-	49,019,945.74
应付销售服务费	-	-	-	56,287.85	56,287.85
应交税费	-	-	-	18,411.19	18,411.19
其他负债	-	-	-	572,317.78	572,317.78
负债总计	49,019,945.74	-	-	19,746,220.05	68,766,165.79
利率敏感度缺口	241,032,860.36	104,453,124.40	52,232,106.85	152,549,795.26	550,267,886.87
上年度末 2021 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	6,236,754.53	-	-	-	6,236,754.53
结算备付金	4,588,529.62	-	-	-	4,588,529.62
存出保证金	105,858.45	-	-	-	105,858.45
交易性金融资产	357,744,868.57	364,068,207.40	70,425,000.00	253,214,066.70	1,045,452,142.67
应收申购款	-	-	-	533,610.97	533,610.97
应收证券清算款	-	-	-	10,487,839.28	10,487,839.28
其他资产	-	-	-	10,001,865.34	10,001,865.34
资产总计	368,676,011.17	364,068,207.40	70,425,000.00	274,237,382.29	1,077,406,600.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,624,302.55	1,624,302.55
应付管理人报酬	-	-	-	438,718.64	438,718.64
应付托管费	-	-	-	146,239.56	146,239.56
应付证券清算款	-	-	-	10,319,666.79	10,319,666.79
卖出回购金融资产款	194,374,000.00	-	-	-	194,374,000.00
应付销售服务费	-	-	-	140,516.19	140,516.19
应交税费	-	-	-	27,505.33	27,505.33
其他负债	-	-	-	851,917.28	851,917.28
负债总计	194,374,000.00	-	-	13,548,866.34	207,922,866.34
利率敏感度缺口	174,302,011.17	364,068,207.40	70,425,000.00	260,688,515.95	869,483,734.52

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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	3,926,073.45	6,993,034.18
	市场利率上升 25 个基点	-3,864,638.24	-6,886,143.06

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 (Valueat 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 2022年6月30日		上年度末 2021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	163,270,842.26	29.67	253,214,066.70	29.12
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	163,270,842.26	29.67	253,214,066.70	29.12

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		
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 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	8,671,708.08	9,702,959.65
	沪深 300 指数下降 5%	-8,671,708.76	-9,702,959.65

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	342,693,026.71	461,282,629.78

第二层次	224,088,407.92	584,169,512.89
第三层次	-	-
合计	566,781,434.63	1,045,452,142.67

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	163,270,842.26	26.38
	其中：股票	163,270,842.26	26.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	403,510,592.37	65.18
	其中：债券	393,150,614.60	63.51
	资产支持证券	10,359,977.77	1.67
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	25,000,000.00	4.04
	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	18,066,894.69	2.92
8	其他各项资产	9,185,723.34	1.48
9	合计	619,034,052.66	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,332,303.44	0.24
C	制造业	118,666,456.58	21.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	27,406,452.60	4.98
F	批发和零售业	2,061,923.16	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	1,747,305.00	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	395,538.82	0.07
J	金融业	3,424,174.00	0.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	7,982,729.77	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	24,378.42	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	163,270,842.26	29.67

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	300298	三诺生物	568,300	15,969,230.00	2.90
2	600580	卧龙电驱	584,300	8,425,606.00	1.53
3	601012	隆基绿能	98,380	6,555,059.40	1.19
4	603018	华设集团	653,100	6,237,105.00	1.13
5	002643	万润股份	278,300	5,805,338.00	1.06
6	000090	天健集团	806,213	5,554,807.57	1.01
7	300760	迈瑞医疗	17,539	5,493,214.80	1.00
8	000778	新兴铸管	1,125,533	5,425,069.06	0.99

9	603916	苏博特	209,500	5,340,155.00	0.97
10	600496	精工钢构	1,148,600	5,306,532.00	0.96
11	601390	中国中铁	800,600	4,915,684.00	0.89
12	002032	苏泊尔	85,200	4,800,168.00	0.87
13	601669	中国电建	603,100	4,746,397.00	0.86
14	002283	天润工业	596,200	4,072,046.00	0.74
15	002078	太阳纸业	330,700	4,070,917.00	0.74
16	600031	三一重工	197,100	3,756,726.00	0.68
17	000789	万年青	340,900	3,695,356.00	0.67
18	601117	中国化学	390,500	3,674,605.00	0.67
19	600284	浦东建设	486,100	3,602,001.00	0.65
20	000708	中信特钢	170,400	3,433,560.00	0.62
21	002966	苏州银行	561,340	3,424,174.00	0.62
22	002837	英维克	137,670	3,405,955.80	0.62
23	601100	恒立液压	48,600	2,999,592.00	0.55
24	688408	中信博	30,246	2,797,150.08	0.51
25	600741	华域汽车	115,400	2,654,200.00	0.48
26	603799	华友钴业	25,400	2,428,748.00	0.44
27	002822	中装建设	390,761	2,043,680.03	0.37
28	600729	重庆百货	94,600	2,040,522.00	0.37
29	600702	舍得酒业	10,000	2,039,900.00	0.37
30	600166	福田汽车	714,200	2,021,186.00	0.37
31	601668	中国建筑	360,400	1,917,328.00	0.35
32	603966	法兰泰克	177,026	1,876,475.60	0.34
33	002345	潮宏基	400,000	1,836,000.00	0.33
34	601111	中国国航	150,500	1,747,305.00	0.32
35	300284	苏交科	246,100	1,715,317.00	0.31
36	002154	报喜鸟	377,200	1,629,504.00	0.30
37	688223	晶科能源	106,500	1,541,055.00	0.28
38	000932	华菱钢铁	292,100	1,486,789.00	0.27
39	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.24
40	300382	斯莱克	80,000	1,253,600.00	0.23
41	300014	亿纬锂能	12,500	1,218,750.00	0.22
42	603035	常熟汽饰	68,400	1,129,968.00	0.21
43	603678	火炬电子	23,200	1,085,992.00	0.20
44	603348	文灿股份	19,900	1,066,640.00	0.19
45	603338	浙江鼎力	20,000	1,014,000.00	0.18
46	601186	中国铁建	120,500	951,950.00	0.17
47	605128	上海沿浦	23,500	875,845.00	0.16
48	002487	大金重工	10,000	417,300.00	0.08
49	688047	龙芯中科	4,636	380,198.36	0.07
50	300850	新强联	3,100	275,993.00	0.05

51	688322	奥比中光	8,332	258,208.68	0.05
52	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.04
53	688400	凌云光	9,403	206,207.79	0.04
54	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.04
55	688259	创耀科技	1,595	126,355.90	0.02
56	688150	莱特光电	5,626	110,269.60	0.02
57	301238	瑞泰新材	2,051	65,775.57	0.01
58	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
59	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
60	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.01
61	301216	万凯新材	943	28,139.12	0.01
62	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
63	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
64	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
65	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
66	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
67	301219	腾远钴业	238	20,901.16	0.00
68	301150	中一科技	249	20,607.24	0.00
69	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
70	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
71	300834	星辉环材	614	18,438.42	0.00
72	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
73	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
74	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
75	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
76	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
77	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
78	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
79	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
80	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
81	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
82	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
83	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
84	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
85	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
86	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
87	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
88	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
89	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
90	301279	金道科技	296	6,751.76	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	002966	苏州银行	19,451,017.00	2.24
2	002822	中装建设	12,051,386.34	1.39
3	601390	中国中铁	10,362,280.00	1.19
4	000778	新兴铸管	9,902,675.44	1.14
5	601615	明阳智能	8,685,073.00	1.00
6	600585	海螺水泥	8,527,554.00	0.98
7	600502	安徽建工	7,966,988.17	0.92
8	300776	帝尔激光	6,960,755.00	0.80
9	601669	中国电建	6,591,044.00	0.76
10	603018	华设集团	6,463,805.00	0.74
11	600547	山东黄金	6,152,468.88	0.71
12	002202	金风科技	5,996,981.00	0.69
13	000708	中信特钢	5,435,358.00	0.63
14	300567	精测电子	5,427,293.25	0.62
15	000090	天健集团	5,305,110.49	0.61
16	300896	爱美客	5,280,709.99	0.61
17	601658	邮储银行	5,179,000.00	0.60
18	601117	中国化学	5,054,793.00	0.58
19	601009	南京银行	4,968,866.00	0.57
20	603916	苏博特	4,945,922.60	0.57

注：买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)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	002966	苏州银行	15,888,025.40	1.83
2	600502	安徽建工	11,083,174.70	1.27
3	600893	航发动力	10,881,024.00	1.25
4	002822	中装建设	9,683,403.00	1.11
5	300073	当升科技	8,422,031.00	0.97
6	300776	帝尔激光	8,033,684.80	0.92
7	600585	海螺水泥	7,644,559.40	0.88
8	601012	隆基绿能	7,447,885.60	0.86
9	601615	明阳智能	7,282,111.00	0.84
10	300298	三诺生物	6,816,320.00	0.78
11	603501	韦尔股份	6,798,961.96	0.78
12	002202	金风科技	6,468,351.00	0.74
13	603596	伯特利	6,082,955.00	0.70

14	600547	山东黄金	5,938,102.20	0.68
15	002311	海大集团	5,931,303.00	0.68
16	601009	南京银行	5,557,176.00	0.64
17	603179	新泉股份	5,549,701.00	0.64
18	300896	爱美客	5,404,471.80	0.62
19	002643	万润股份	5,362,521.48	0.62
20	600580	卧龙电驱	5,328,449.74	0.61

注：卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交量)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	413,263,588.21
卖出股票收入（成交）总额	450,183,138.34

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	118,476,928.49	21.53
	其中：政策性金融债	35,676,294.52	6.48
4	企业债券	65,279,093.15	11.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	21,766,056.99	3.96
7	可转债（可交换债）	187,614,843.03	34.10
8	同业存单	-	-
9	其他	13,692.94	0.00
10	合计	393,150,614.60	71.45

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	149564	21 广发 07	500,000	52,232,106.85	9.49
2	112670	18GLPR2	300,000	30,606,402.74	5.56
3	210407	21 农发 07	300,000	30,573,082.19	5.56
4	149502	21 长江 C1	300,000	30,568,527.12	5.56
5	113052	兴业转债	184,310	20,582,180.48	3.74

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	136572	扬子 1 优	90,000	8,485,260.87	1.54
2	193167	安车 2A1	170,000	1,874,716.90	0.34

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 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 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、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，碧桂园地产集团有限公司在本报告期内被监管部门立案调查，兴业银行股份有限公司、中国农业发展银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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的备选股票库的情形。

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	160,550.29
2	应收清算款	8,968,165.64
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	57,007.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	9,185,723.34
---	----	--------------

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	113052	兴业转债	20,582,180.48	3.74
2	110080	东湖转债	13,107,381.97	2.38
3	128132	交建转债	9,776,883.16	1.78
4	127016	鲁泰转债	7,725,194.22	1.40
5	110047	山鹰转债	7,430,186.90	1.35
6	128129	青农转债	7,350,124.66	1.34
7	127029	中钢转债	4,608,827.63	0.84
8	123121	帝尔转债	4,430,979.45	0.81
9	110081	闻泰转债	4,389,048.85	0.80
10	127032	苏行转债	4,166,739.42	0.76
11	127045	牧原转债	4,129,284.74	0.75
12	123076	强力转债	3,821,161.36	0.69
13	127012	招路转债	3,467,934.63	0.63
14	113044	大秦转债	3,315,365.70	0.60
15	128138	侨银转债	3,255,569.05	0.59
16	113050	南银转债	2,646,294.47	0.48
17	113623	凤 21 转债	2,385,071.52	0.43
18	128121	宏川转债	2,278,209.83	0.41
19	110043	无锡转债	2,240,348.82	0.41
20	113037	紫银转债	2,077,621.37	0.38
21	128135	洽洽转债	1,912,892.19	0.35
22	113033	利群转债	1,854,829.21	0.34
23	127025	冀东转债	1,836,778.52	0.33
24	110063	鹰 19 转债	1,829,061.80	0.33
25	110079	杭银转债	1,771,493.29	0.32
26	110053	苏银转债	1,754,894.15	0.32
27	123107	温氏转债	1,705,496.25	0.31
28	113563	柳药转债	1,704,357.53	0.31
29	110082	宏发转债	1,654,355.41	0.30
30	110067	华安转债	1,652,339.59	0.30
31	127033	中装转 2	1,605,961.63	0.29
32	110057	现代转债	1,431,327.87	0.26
33	128119	龙大转债	1,420,871.62	0.26
34	127034	绿茵转债	1,219,172.30	0.22
35	128087	孚日转债	1,170,635.57	0.21
36	113046	金田转债	1,105,101.91	0.20
37	123049	维尔转债	897,785.91	0.16
38	111000	起帆转债	765,708.75	0.14

39	128130	景兴转债	740,840.17		0.13
40	127028	英特转债	727,223.84		0.13
41	113505	杭电转债	724,820.94		0.13
42	128037	岩土转债	583,980.41		0.11
43	113606	荣泰转债	583,354.65		0.11
44	127039	北港转债	562,388.24		0.10
45	127049	希望转 2	548,985.93		0.10
46	128081	海亮转债	457,470.83		0.08
47	128071	合兴转债	413,953.85		0.08
48	123132	回盛转债	362,765.51		0.07
49	113549	白电转债	352,139.18		0.06
50	128034	江银转债	330,762.13		0.06
51	127036	三花转债	262,064.16		0.05
52	127035	濮耐转债	173,312.62		0.03
53	113532	海环转债	159,709.82		0.03
54	123035	利德转债	131,135.68		0.02
55	128083	新北转债	62,544.26		0.01

7.12.5 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。

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	1,591	254,672.41	377,439,312.20	93.1526	27,744,498.27	6.8474
太平睿盈混合 C	4,683	22,145.74	71,946,856.48	69.3741	31,761,644.84	30.6259
合计	6,173	82,438.41	449,386,168.68	88.3067	59,506,143.11	11.6933

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	874, 986. 73	0. 2159
	太平睿盈混合 C	1, 244, 416. 62	1. 1999
	合计	2, 119, 403. 35	0. 4165

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	10~50
	太平睿盈混合 C	0~10
	合计	10~50
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

§ 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)	229, 947, 908. 95	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	472, 480, 163. 55	289, 720, 518. 67
本报告期基金总申购份额	55, 038, 239. 64	31, 374, 369. 26
减：本报告期基金总赎回份额	122, 334, 592. 72	217, 386, 386. 61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	405, 183, 810. 47	103, 708, 501. 32

§ 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

- (1) 本基金管理人于 2022 年 1 月 21 日发布公告，自 2022 年 1 月 19 日起季勇先生不再担任公司助理总经理职务。
- (2) 本基金管理人于 2022 年 6 月 11 日发布公告，自 2022 年 6 月 10 日起董晓亮先生担任公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

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，本基金、托管人的托管业务部门及其相关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	2	847,736,231. 43	100.00	612,396.27	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	866,942,026.66	100.00	2,502,890,000.00	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基金改聘会计师事务所公告	指定报刊、基金管理人网站	2022年01月21日
2	太平睿盈混合型证券投资基金2021年第四季度报告	指定报刊、基金管理人网站	2022年01月24日
3	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行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	2022年03月15日
4	太平睿盈混合型证券投资基金2021年年度报告	指定报刊、基金管理人网站	2022年03月30日
5	太平基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销费率优惠活动的公告	指定报刊、基金管理人网站	2022年04月01日
6	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	2022年04月11日
7	太平睿盈混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2022年04月20日
8	太平睿盈混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2022年04月20日
9	太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2022年第1号)	指定报刊、基金管理人网站	2022年04月20日
10	太平睿盈混合型证券投资基金2022年第一季度报告	指定报刊、基金管理人网站	2022年04月22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	20220101-20220630	244,316,912.51	-	-	244,316,912.51	48.0096
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：报告期初、期末同一投资者通过多个基金账户持有本基金的合并计算。

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

2022 年 8 月 31 日