

太平睿盈混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：2020 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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2020 年 8 月 25 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	45

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	45
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	45
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 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	375,928,122.30 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	249,406,082.82 份	126,522,039.48 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×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	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	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		上海市浦东新区花园石桥路 33 号	深圳市深南大道 7088 号招商银

	花旗集团大厦 17 楼 1708 室	行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	范宇	李建红

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	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

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	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

§ 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(2020 年 1 月 1 日-2020 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	13,661,186.84	6,494,025.46
本期利润	12,886,577.97	6,193,299.68
加权平均基金份额本期利润	0.0544	0.0528
本期加权平均净值利润率	5.12%	4.98%
本期基金份额净值增长率	5.20%	4.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	19,330,644.00	9,632,915.02
期末可供分配基金份额利润	0.0775	0.0761

期末基金资产净值	272,765,278.21	137,756,303.30
期末基金份额净值	1.0937	1.0888
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	11.52%	8.96%

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

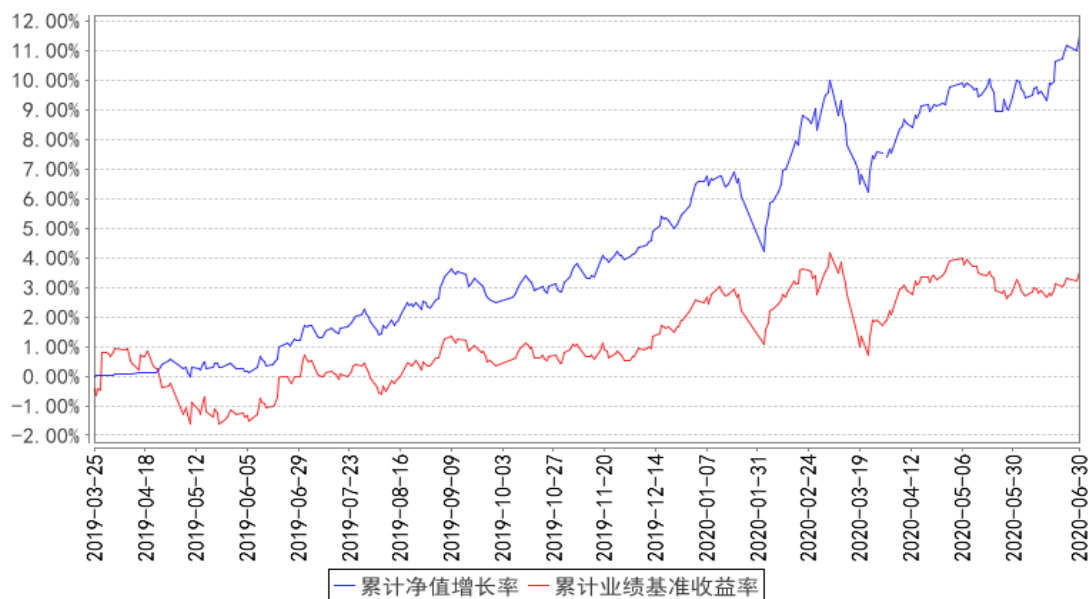
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.06%	0.28%	0.74%	0.19%	1.32%	0.09%
过去三个月	3.75%	0.25%	1.66%	0.20%	2.09%	0.05%
过去六个月	5.20%	0.36%	1.20%	0.29%	4.00%	0.07%
过去一年	10.16%	0.28%	3.53%	0.23%	6.63%	0.05%
自基金合同生效起至	11.52%	0.25%	3.53%	0.25%	7.99%	0.00%

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	2.01%	0.29%	0.74%	0.19%	1.27%	0.10%
过去三个月	3.62%	0.25%	1.66%	0.20%	1.96%	0.05%
过去六个月	4.94%	0.36%	1.20%	0.29%	3.74%	0.07%
自基金合同生效起至	8.96%	0.29%	3.68%	0.24%	5.28%	0.05%

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 2020 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 2020 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%。

目前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，在投资管理、策略设计、产品设计、客户服务等方面配置了专业团队及集中了优势资源，力求为客户创造长期持续稳健的回报。截至本报告期末，公司共管理 10 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。

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		
林开盛	本基金的基金经理、太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金基金经理	2019 年 03 月 25 日	2020 年 04 月 13 日	10 年	上海财经大学金融学专业证券投资方向硕士。具有证券投资基金从业资格。2009 年 7 月至 2016 年 4 月在申银万国证券研究所任首席分析师。2016 年 4 月加入本公司人，从事投资研究相关工作。2017 年 5 月 9 日起担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理；2019 年 3 月 25 日至 2020 年 4 月 13 日担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 18 日起担任太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金基金经理。中国国籍。
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	2019 年 03 月 25 日	-	7 年	美国本特利商学院金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2013 年 5 月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公

	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				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。中国国籍。
陈晓	本基金的基金经理	2019 年 03 月 29 日	-	9 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负责人。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。中国国籍。

注：1、基金经理的任职日期和离任日期一般情况下指公司对外公告之日；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 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

2020 年第二季度国内经济基本面反弹略超预期，受疫情冲击影响，一季度宏观基本面多项数据均创出历史新低，二季度随着国内有效控制住疫情，返工复工有序推进，经济最悲观预期阶段已经过去。但同时也要注意国外疫情控制远不及国内有效，全球整体经济仍然受到疫情严重影响，外需依然低迷，全球供应链体现依旧未恢复正常运转，预计仍将对国内经济产生一定的拖累。

资金方面二季度前半段依然延续前期疫情期间宽松状态，但随着国内疫情得到控制，经济开始出现明显复苏，资金面边际出现收紧。从央行公开市场操作上也可以明显看出从疫情期间的预防性宽松转向相机抉择式操作。债券市场对于货币政策环境的边际转向也较为灵敏，债券收益率出现明显上行，整体收益率曲线呈现出熊平走势。权益市场方面二季度整体表现较好，市场指数出现明显的修复行情。同时市场出现了明显的分化行情，医药医疗、消费、科技板块表现较为活跃，传统行业表现一般，结构性行情得到进一步演绎。整体而言，二季度市场风险偏好出现一定上升，权益市场表现好于债券市场。

展望下半年，预计“六保”“六稳”的财政政策将继续发力，但仍需控制在“防风险”的前提之下，因此相对灵活适度偏中性的货币政策将成为下半年的常态，宽信用将成为主基调，宽货

币逐渐转变为中性货币环境。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，积极增加 AAA 评级信用品种配置，同时保持中短久期以控制风险。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 5.20%，同期业绩比较基准收益率为 1.20%。太平睿盈 C 的份额净值增长率为 4.94%，同期业绩比较基准收益率为 1.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年经历了新冠疫情这个黑天鹅之后经济在上半年走出一个 V 型走势，对于下半年而言，经济将会是一个相对明确的延续复苏的走势。从经济数据来看，工业生产、投资、消费等等都是在持续改善。地产销售也是显著超越市场预期，虽然地产调控政策依然没有松动，但整体对于下半年地产对于经济的拉动依旧乐观。国外而言，三季度疫情可能得到缓解，复工也会加快，届时可能会迎来国内外经济复苏的共振。

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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金资产的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员由主席负责，成员包括稽核风控部负责人、固定收益投资部负责人、研究部负责人、基金运营部负责人等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关约定，本基金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。

本半年度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

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

§ 6 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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,810,559.22	1,716,710.61
结算备付金		872,088.32	158,696.94
存出保证金		48,679.20	36,177.61
交易性金融资产	6.4.7.2	541,268,104.86	493,485,390.45
其中：股票投资		118,401,728.56	81,128,148.29
基金投资		—	—
债券投资		422,866,376.30	412,357,242.16
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		1,609,444.17	-
应收利息	6.4.7.5	5,835,404.62	5,793,095.67
应收股利		-	-
应收申购款		1,998.00	10,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		554,446,278.39	501,200,071.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		143,306,276.70	124,253,670.62
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,075.74	20,004.82
应付管理人报酬		196,543.61	190,058.43
应付托管费		65,514.53	63,352.82
应付销售服务费		53,386.73	51,123.21
应付交易费用	6.4.7.7	108,892.25	33,184.86
应交税费		22,826.65	40,429.80
应付利息		76,673.07	50,412.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,507.60	170,075.58
负债合计		143,924,696.88	124,872,313.08
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	375,928,122.30	362,237,456.75
未分配利润	6.4.7.10	34,593,459.21	14,090,301.45
所有者权益合计		410,521,581.51	376,327,758.20
负债和所有者权益总计		554,446,278.39	501,200,071.28

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 375,928,122.30 份，其中 A 类基金份额总额为 249,406,082.82 份，基金份额净值为 1.0937；C 类基金份额总额为 126,522,039.48 份，基金份额净值为 1.0888。

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 3 月 25 日（基金合 同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		22,631,266.28	2,991,784.67
1. 利息收入		6,593,366.77	1,444,869.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,188.93	531,054.91
债券利息收入		6,544,598.95	804,517.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,578.89	109,296.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,071,706.65	-47,939.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,883,331.54	-253,163.99
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,288,389.29	-120,236.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	899,985.82	325,460.65
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,075,334.65	1,033,489.87
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	41,527.51	561,364.57
减：二、费用		3,551,388.63	602,776.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,121,696.13	283,013.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	373,898.77	94,337.77
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	308,983.53	-
4. 交易费用	6.4.7.19	333,413.56	49,327.11
5. 利息支出		1,277,436.57	110,128.08
其中：卖出回购金融资产支出		1,277,436.57	110,128.08
6. 税金及附加		20,019.61	1,592.67
7. 其他费用	6.4.7.20	115,940.46	64,377.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,079,877.65	2,389,008.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,079,877.65	2,389,008.39

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2019 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 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)	229,947,908.95	-	229,947,908.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,389,008.39	2,389,008.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-48,798,568.70	-156,870.07	-48,955,438.77

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	50,764,893.28	78,378.26	50,843,271.54
2. 基金赎回款	-99,563,461.98	-235,248.33	-99,798,710.31
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)	181,149,340.25	2,232,138.32	183,381,478.57

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：

尤象都

尤象都

孙波

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 $\times$ 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 2020 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30

日止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

本基金本报告期未发生重大会计差错的内容和更正金额。

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，

其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,810,559.22
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	4,810,559.22

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	112,764,452.53	118,401,728.56	5,637,276.03
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	66,541,449.66	66,488,776.30
	银行间市场	357,242,049.68	356,377,600.00
	合计	423,783,499.34	422,866,376.30
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	536,547,951.87	541,268,104.86	4,720,152.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末无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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,140.08
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	392.40
应收债券利息	5,833,850.24
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	21.90
合计	5,835,404.62

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	94,650.83
银行间市场应付交易费用	14,241.42
合计	108,892.25

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
应付证券出借违约金	—

预提审计费	29,835.26
预提信息披露费	59,672.34
合计	89,507.60

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	245,545,301.49	245,545,301.49
本期申购	37,535,092.38	37,535,092.38
本期赎回（以“-”号填列）	-33,674,311.05	-33,674,311.05
-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	249,406,082.82	249,406,082.82

太平睿盈混合 C

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	116,692,155.26	116,692,155.26
本期申购	12,109,757.63	12,109,757.63
本期赎回（以“-”号填列）	-2,279,873.41	-2,279,873.41
-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	126,522,039.48	126,522,039.48

注：申购含红利再投、转换入份额；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	4,845,533.56	4,867,512.06	9,713,045.62
本期利润	13,661,186.84	-774,608.87	12,886,577.97
本期基金份额 交易产生的变 动数	823,923.60	-64,351.80	759,571.80
其中：基金申 购款	2,097,642.19	552,150.59	2,649,792.78
基金赎	-1,273,718.59	-616,502.39	-1,890,220.98

回款			
本期已分配利润			
本期末	19,330,644.00	4,028,551.39	23,359,195.39
太平睿盈混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,471,672.02	1,905,583.81	4,377,255.83
本期利润	6,494,025.46	-300,725.78	6,193,299.68
本期基金份额交易产生的变动数	667,217.54	-3,509.23	663,708.31
其中：基金申购款	816,103.93	8,352.38	824,456.31
基金赎回款	-148,886.39	-11,861.61	-160,748.00
本期已分配利润			
本期末	9,632,915.02	1,601,348.80	11,234,263.82

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	38,693.35
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	6,211.87
其他	283.71
合计	45,188.93

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	103,209,143.39
减：卖出股票成本总额	92,325,811.85
买卖股票差价收入	10,883,331.54

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	376,334,301.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	366,024,604.36
减：应收利息总额	5,021,307.87
买卖债券差价收入	5,288,389.29

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	899,985.82
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	899,985.82

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,075,334.65
股票投资	2,059,313.31
债券投资	-3,134,647.96
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	-1,075,334.65

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	41,527.51
合计	41,527.51

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	322,301.06
银行间市场交易费用	11,112.50
合计	333,413.56

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
银行划款手续费	7,832.86
债券账户维护费	18,600.00
合计	115,940.46

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，本基金无须作披露或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表之后、半年度报告批准报出日之前批准、公告或实施的利润分配的情况如下：根据本基金管理人于 2020 年 7 月 13 日发布的分红公告，向截止 2020 年 7 月 15 日止在本基金注册登记机构登记在册的 A 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.46 元；B 类基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.46 元。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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
太平资产管理有限公司（“太平资管”）	基金管理人的股东
中原证券股份有限公司（“中原证券”）	基金管理人的原股东
安石投资管理有限公司（“安石投资”）	基金管理人的股东

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]2864 号文核准，基金管理人原股东中原证券股份有限公司将其持有的基金管理人的 8.5%股权转让给太平资产管理有限公司。本次股权变更于 2020 年 2 月 19 日完成工商注册变更，变更后太平资管、安石投资在太平基金的股权占比分别为 91.5%、8.5%。

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，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，未有通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内，未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内，未发生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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,121,696.13	283,013.36
其中：支付销售机构的客户维护费	44,838.30	16,704.10

注：支付基金管理人太平基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	373,898.77	94,337.77

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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 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	0.00	0.00
合计	0.00	0.00	0.00

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×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

本报告期内，本基金管理人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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019年3月25日（基金合同生效日）至2019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	4,810,559.22	38,693.35	1,744,646.86	128,223.38

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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(2020 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
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688100	威胜信息	2020 年 1 月 9 日	2020 年 7 月 21 日	科创板锁定	13.78	25.92	11,602	159,875.56	300,723.84	-
688169	石头科技	2020 年 2 月 13 日	2020 年 8 月 21 日	科创板锁定	271.12	365.14	2,152	583,450.24	785,781.28	-
688266	泽璟制药	2020 年 1 月 16 日	2020 年 7 月 23 日	科创板锁定	33.76	81.66	20,548	693,700.48	1,677,949.68	-
688277	天智航	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 7 日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688312	燕麦科技	2020 年 5 月 29 日	2020 年 12 月 08 日	科创板锁定	19.68	41.77	7,390	145,435.20	308,680.30	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-

688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
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
128112	歌尔转 2	2020 年 06 月 12 日	2020 年 07 月 13 日	新债未上市	100.00	100.00	730	73,000.00	73,000.00	-

注：1、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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。

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

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 135,529,276.70 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101800742	18 平安不动 MTN001	2020 年 7 月 1 日	103.05	100,000	10,305,000.00
101800792	18 津城建 MTN012A	2020 年 7 月 1 日	102.89	100,000	10,289,000.00
101800942	18 平安不动 MTN002	2020 年 7 月 1 日	102.69	100,000	10,269,000.00
101801218	18 中铝集 MTN004	2020 年 7 月 1 日	102.20	200,000	20,440,000.00

101801449	18 平安租赁 MTN001	2020 年 7 月 1 日	102.33	100,000	10,233,000.00
101900615	19 龙源电力 MTN001	2020 年 7 月 1 日	102.02	100,000	10,202,000.00
101901739	19 远东租赁 MTN001	2020 年 7 月 1 日	101.21	200,000	20,242,000.00
102000295	20 中化工(疫情防控债)MTN005A	2020 年 7 月 1 日	99.35	200,000	19,870,000.00
102000709	20 苏国信 MTN006	2020 年 7 月 1 日	97.57	200,000	19,514,000.00
112081090	20 宁波通商银行 CD119	2020 年 7 月 1 日	99.39	20,000	1,987,800.00
200006	20 附息国债 06	2020 年 7 月 6 日	98.78	110,000	10,865,800.00
合计				1,430,000	144,217,600.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，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 7,777,000 元，于 2020 年 7 月 20 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，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。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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	25,022,500.00	20,026,000.00
合计	25,022,500.00	20,026,000.00

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	11,717,800.00	-
合计	11,717,800.00	-

注：截至上年度末，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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	297,775,899.10	359,088,480.40
AAA 以下	42,358,785.60	23,101,229.36
未评级	45,991,391.60	10,141,532.40
合计	386,126,076.30	392,331,242.16

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 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 143,306,276.70 元将在一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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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%。

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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 2.42%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 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为 546,078,664.08 元，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。

综合上述各项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。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金、存出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 2020 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,810,559.22	-	-	-	-	-	-4,810,559.22
结算备付金	872,088.32	-	-	-	-	-	872,088.32
存出保证金	48,679.20	-	-	-	-	-	48,679.20
交易性金融资产	25,448,218.48	6,932,206.52	66,720,433.20	280,155,081.70	43,610,436.40	118,401,728.56	541,268,104.86
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	5,835,404.62	5,835,404.62

						2	
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,998.00	1,998.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,609,444.17	1,609,444.17
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,179,545.22	6,932,206.52	66,720,433.20	280,155,081.70	43,610,436.40	125,848,575.35	554,446,278.39
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,075.74	5,075.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	196,543.61	196,543.61
应付托管费	-	-	-	-	-	65,514.53	65,514.53
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	143,306,276.70	-	-	-	-	-	143,306,276.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	53,386.73	53,386.73
应付交易费用	-	-	-	-	-	108,892.25	108,892.25
应付税费	-	-	-	-	-	22,826.65	22,826.65
应付利息	-	-	-	-	-	76,673.07	76,673.07
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	89,507.60	89,507.60
负债总计	143,306,276.70	-	-	-	-	618,420.18	143,924,696.88
利率敏感度缺口	-112,126.731.48	6,932,206.52	66,720,433.20	280,155,081.70	43,610,436.40	125,230,155.17	410,521,581.51
上年度末							
2019 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,716,710.61	-	-	-	-	-	1,716,710.61
结算备付金	158,696.94	-	-	-	-	-	158,696.94
存出保证金	36,177.61	-	-	-	-	-	36,177.61

金							
交易性金融资产	-	-	45,516,862.90	338,649,149.50	28,191,229.76	81,128,148.29	493,485,390.45
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	5,793,095.67	5,793,095.67
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	500.00	-	-	-	-	9,500.00	10,000.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,912,085.16	-	45,516,862.90	338,649,149.50	28,191,229.76	86,930,743.96	501,200,071.28
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,004.82	20,004.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	190,058.43	190,058.43
应付托管费	-	-	-	-	-	63,352.82	63,352.82
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	121,854,670.62	2,213,000.00	186,000.00	-	-	-	124,253,670.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	51,123.21	51,123.21
应付交易费用	-	-	-	-	-	33,184.86	33,184.86
应付税费	-	-	-	-	-	40,429.80	40,429.80
应付利息	-	-	-	-	-	50,412.94	50,412.94
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	170,075.58	170,075.58
负债总计	121,854,670.62	2,213,000.00	186,000.00	-	-	618,642.46	124,872,313.08
利率敏感度缺口	-119,942,585.46	-2,213,000.00	45,330,862.90	338,649,149.50	28,191,229.76	86,312,101.50	376,327,758.20

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

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	2,226,156.04	1,607,065.72
	市场利率上升 25 个基点	-2,189,550.16	-1,595,266.28

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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	118,401,728.56	28.84	81,128,148.29	21.56
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	422,866,376.30	103.01	—	—
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	541,268,104.86	131.85	81,128,148.29	21.56

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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	5,621,520.57	3,398,776.93
	沪深 300 指数下降 5%	-5,621,520.57	-3,398,776.93

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日, 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	118,401,728.56	21.35
	其中: 股票	118,401,728.56	21.35
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	422,866,376.30	76.27
	其中: 债券	422,866,376.30	76.27
	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	5,682,647.54	1.02
8	其他各项资产	7,495,525.99	1.35
9	合计	554,446,278.39	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	4,573,000.00	1.11
C	制造业	57,533,315.09	14.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,900,400.00	1.19
E	建筑业	10,633,800.00	2.59
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	3,588,900.00	0.87
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,458,811.47	1.57
J	金融业	22,871,502.00	5.57
K	房地产业	7,842,000.00	1.91
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	118,401,728.56	28.84

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	000002	万 科A	300,000	7,842,000.00	1.91
2	601128	常熟银行	700,000	5,257,000.00	1.28
3	000333	美的集团	75,000	4,484,250.00	1.09
4	600276	恒瑞医药	48,000	4,430,400.00	1.08
5	600519	贵州茅台	3,000	4,388,640.00	1.07
6	300702	天宇股份	40,100	4,263,432.00	1.04
7	000001	平安银行	300,000	3,840,000.00	0.94
8	601668	中国建筑	800,000	3,816,000.00	0.93
9	600900	长江电力	200,000	3,788,000.00	0.92
10	002439	启明星辰	80,000	3,365,600.00	0.82
11	601186	中国铁建	400,000	3,352,000.00	0.82
12	000651	格力电器	55,000	3,111,350.00	0.76
13	300454	深信服	15,000	3,089,400.00	0.75
14	300760	迈瑞医疗	10,000	3,057,000.00	0.74
15	300059	东方财富	150,000	3,030,000.00	0.74
16	601398	工商银行	600,000	2,988,000.00	0.73
17	600489	中金黄金	300,000	2,742,000.00	0.67
18	600309	万华化学	50,000	2,499,500.00	0.61
19	600612	老凤祥	51,861	2,499,181.59	0.61
20	601669	中国电建	700,000	2,422,000.00	0.59
21	000739	普洛药业	100,100	2,331,329.00	0.57
22	601318	中国平安	30,000	2,142,000.00	0.52
23	601006	大秦铁路	300,000	2,112,000.00	0.51
24	600521	华海药业	60,000	2,035,800.00	0.50
25	601211	国泰君安	117,700	2,031,502.00	0.49
26	601939	建设银行	300,000	1,893,000.00	0.46
27	600547	山东黄金	50,000	1,831,000.00	0.45

28	002475	立讯精密	35,099	1,802,333.65	0.44
29	600585	海螺水泥	33,000	1,746,030.00	0.43
30	002241	歌尔股份	58,000	1,702,880.00	0.41
31	601288	农业银行	500,000	1,690,000.00	0.41
32	688266	泽璟制药	20,548	1,677,949.68	0.41
33	600887	伊利股份	50,000	1,556,500.00	0.38
34	002352	顺丰控股	27,000	1,476,900.00	0.36
35	300326	凯利泰	49,900	1,452,090.00	0.35
36	603986	兆易创新	6,000	1,415,460.00	0.34
37	300750	宁德时代	8,000	1,394,880.00	0.34
38	002371	北方华创	8,000	1,367,280.00	0.33
39	600104	上汽集团	80,300	1,364,297.00	0.33
40	300124	汇川技术	35,000	1,329,650.00	0.32
41	000661	长春高新	3,000	1,305,900.00	0.32
42	002007	华兰生物	25,000	1,252,750.00	0.31
43	000977	浪潮信息	30,000	1,175,400.00	0.29
44	600674	川投能源	120,000	1,112,400.00	0.27
45	600170	上海建工	340,000	1,043,800.00	0.25
46	688169	石头科技	2,152	785,781.28	0.19
47	603160	汇顶科技	3,200	713,280.00	0.17
48	000538	云南白药	7,603	713,237.43	0.17
49	002332	仙琚制药	30,000	505,200.00	0.12
50	688312	燕麦科技	7,390	308,680.30	0.08
51	688100	威胜信息	11,602	300,723.84	0.07
52	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
53	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.03
54	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
55	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
56	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
57	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
58	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
59	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
60	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
61	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	000002	万 科 A	7,341,589.00	1.95
2	300454	深信服	5,927,714.00	1.58
3	601128	常熟银行	5,105,000.00	1.36

4	002439	启明星辰	4,597,257.00	1.22
5	600276	恒瑞医药	4,263,807.00	1.13
6	000333	美的集团	3,979,400.00	1.06
7	000001	平安银行	3,876,000.00	1.03
8	300760	迈瑞医疗	3,717,780.00	0.99
9	300702	天宇股份	3,550,408.00	0.94
10	600519	贵州茅台	3,492,370.00	0.93
11	600909	华安证券	3,201,079.00	0.85
12	000651	格力电器	3,132,500.00	0.83
13	002812	恩捷股份	3,086,697.00	0.82
14	603259	药明康德	3,061,457.00	0.81
15	601668	中国建筑	2,578,000.00	0.69
16	600489	中金黄金	2,557,500.00	0.68
17	601988	中国银行	2,492,000.00	0.66
18	300059	东方财富	2,466,000.00	0.66
19	600019	宝钢股份	2,309,000.00	0.61
20	600900	长江电力	2,222,500.00	0.59

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	601988	中国银行	4,315,000.00	1.15
2	601328	交通银行	4,219,000.00	1.12
3	601818	光大银行	4,182,500.00	1.11
4	600588	用友网络	4,164,370.00	1.11
5	603259	药明康德	3,354,243.80	0.89
6	300454	深信服	3,265,800.00	0.87
7	600483	福能股份	3,201,022.00	0.85
8	600438	通威股份	2,902,500.00	0.77
9	600909	华安证券	2,853,013.78	0.76
10	002812	恩捷股份	2,382,910.00	0.63
11	002271	东方雨虹	2,307,200.00	0.61
12	000333	美的集团	2,038,400.00	0.54
13	600216	浙江医药	1,992,000.00	0.53
14	600019	宝钢股份	1,960,000.00	0.52
15	002439	启明星辰	1,911,924.00	0.51
16	300015	爱尔眼科	1,745,163.00	0.46
17	601398	工商银行	1,731,200.00	0.46
18	601166	兴业银行	1,571,000.00	0.42
19	600863	内蒙华电	1,539,030.08	0.41
20	600763	通策医疗	1,463,047.00	0.39

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	127,540,078.81
卖出股票收入（成交）总额	103,209,143.39

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	24,011,748.60	5.85
2	央行票据	—	—
3	金融债券	67,128,100.00	16.35
	其中：政策性金融债	46,897,100.00	11.42
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	265,965,100.00	64.79
7	可转债（可交换债）	53,898,070.80	13.13
8	同业存单	11,717,800.00	2.85
9	其他	145,556.90	0.04
10	合计	422,866,376.30	103.01

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	200401	20 农发 01	250,000	25,022,500.00	6.10
2	200205	20 国开 05	220,000	21,874,600.00	5.33
3	200006	20 附息国债 06	220,000	21,731,600.00	5.29
4	101801218	18 中铝集 MTN004	200,000	20,440,000.00	4.98
5	101900661	19 中建材 MTN001	200,000	20,246,000.00	4.93

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

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

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

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

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	48,679.20
2	应收证券清算款	1,609,444.17
3	应收股利	—
4	应收利息	5,835,404.62
5	应收申购款	1,998.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,495,525.99

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	132011	17 浙报 EB	6,256,320.00	1.52
2	113011	光大转债	4,562,400.00	1.11
3	127012	招路转债	4,029,200.00	0.98
4	113547	索发转债	3,150,090.00	0.77
5	132007	16 凤凰 EB	3,088,560.00	0.75
6	132008	17 山高 EB	2,590,539.60	0.63
7	110056	亨通转债	2,379,800.00	0.58
8	110053	苏银转债	1,078,265.60	0.26
9	110058	永鼎转债	1,026,100.00	0.25
10	113528	长城转债	1,023,900.00	0.25
11	113017	吉视转债	991,300.00	0.24

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

无。

§ 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	355	702,552.35	237,132,080.44	95.0787	12,274,002.38	4.9213
太平 睿盈 混合 C	49	2,582,082.44	123,637,794.83	97.7204	2,884,244.65	2.2796
合计	384	978,979.49	360,769,875.27	95.9678	15,158,247.03	4.0322

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	520,084.73	0.2085
	太平睿盈混合 C	1,032,147.90	0.8158
	合计	1,552,232.63	0.4129

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	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	太平睿盈混合 A	0
	太平睿盈混合 C	0
	合计	0

§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	245,545,301.49	116,692,155.26
本报告期基金总申购份额	37,535,092.38	12,109,757.63
减：本报告期基金总赎回份额	33,674,311.05	2,279,873.41
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	249,406,082.82	126,522,039.48

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

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

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

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

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

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，基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。

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	222,783,127.52	100.00%	161,060.55	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	255,833,070.60	100.00%	542,977,000.00	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	指定报刊、基金管理人	2020 年 2 月 20 日

	增加汇林保大为销售机构并参加其费率优惠的公告	网站	
2	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加上海中正达广基金销售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	2020 年 3 月 12 日
3	太平基金管理有限公司关于调整旗下基金在部分销售机构费率优惠活动的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 3 月 17 日
4	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 3 月 17 日
5	太平基金管理有限公司关于公司旗下基金定投、转换业务及相关费率优惠活动的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 3 月 31 日
6	太平基金管理有限公司关于林开盛卸任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 4 月 15 日
7	关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入业务限额的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 4 月 18 日
8	关于太平睿盈混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入业务的公告	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 4 月 23 日
9	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金基金销售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	2020 年 5 月 11 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	指定报刊、基金管理人网站	2020 年 6 月 15 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	20200101-20200630	128,779,515.30	37,361,292.73	0.00	166,140,808.03	44.1948

机 构	2	20200101 -2020063 0	100,810,794.5 5	0.00	0.00	100,810,794.55	26.81 65
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。							

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：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室）

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

2020 年 8 月 31 日