

太平睿盈混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 24 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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 2019 年 3 月 25 日起至 2019 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 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 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 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 39 |
| 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 | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 41 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 42 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |

| | |
|--|-----------|
| 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 | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 43 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 44 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 45 |
| 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 | 45 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 45 |
| § 10 重大事件揭示 | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 46 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 46 |
| 10.8 其他重大事件 | 47 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 48 |
| 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 | 48 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 48 |
| § 12 备查文件目录 | 48 |
| 12.1 备查文件目录 | 48 |
| 12.2 存放地点 | 48 |
| 12.3 查阅方式 | 49 |

§ 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 |
| 交易代码 | 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 | 181,149,340.25 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 追求在严格控制风险的前提下，通过资产配置和灵活运用多种投资策略，争取高于业绩收益比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取主动投资管理的投资模式。在深入研究国内外的宏观经济走势，跟踪资产市场环境变化，通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略，将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。其中，当权益市场资产价格明显上涨时，适当增加权益类资产配置比例；当权益市场处于下行周期且市场风险偏好下降时，适当增加固定收益类资产配置比例，并通过灵活运用衍生品合约的套期保值与对冲功能，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本管理人将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对资产组合进行积极管理。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资思路，精选优质价值型股票进行重点投资。</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>本基金的行业配置，将根据宏观经济形势、国家政策变化、各行业景气差异以及市场风险偏好等因素的变化，结合历史经验总结，对行业配置不断进行调整和优化。</p> <p>（2）个股精选策略</p> <p>研究员对上市公司进行深入分析和紧密调研，精选行业景气向上、拥有显著竞争优势且估值存在提升空间的优质公司。本基金将选择合适时机，对此类优质公司进行投资。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>本基金将根据对现货和期货市场的分析，发挥股指期货杠杆效应和流动性好的特点，采用股指期货在短期内取代部分现货，获取市场敞口，投资策略包括多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值指当基金需要买入现货时，为避免市场冲击，提前建立股指期货多头头寸，然后逐步买入现货并解除股指期货多头，当完成现货建仓后将股指期货平仓；空头套期保值指当基金需要卖出现货时，先建立股指期货空头头寸，然后逐步卖出现货并解除股指期货空头，当现货全部清仓后将股指期货平仓。本基金在股指期货套期保值过程中，将定期测算投资组合与股指期货的相关性、投资组合 beta 的稳定性，精细化确定投资方案比例。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金以提高对利率风险管理能力，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与国债期货投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析；构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金通过考量宏观经济走势、支持资产所在行业景气情况、资产池结构、提前偿还率、违约率、市场利率等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×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 | 王刚 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-38556787 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | wanggang@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 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室 | 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 | | 汤海涛 | 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》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.taipingfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 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(2019 年 3 月 25 日-2019 年 6 月 30 日) |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 1,355,518.52 |
| 本期利润 | 2,389,008.39 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0132 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.33% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.23% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 1,415,171.20 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0078 |
| 期末基金资产净值 | 183,381,478.57 |
| 期末基金份额净值 | 1.0123 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.23% |

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。

4、本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 25 日，至本报告期末不满一年。

3.2 基金净值表现

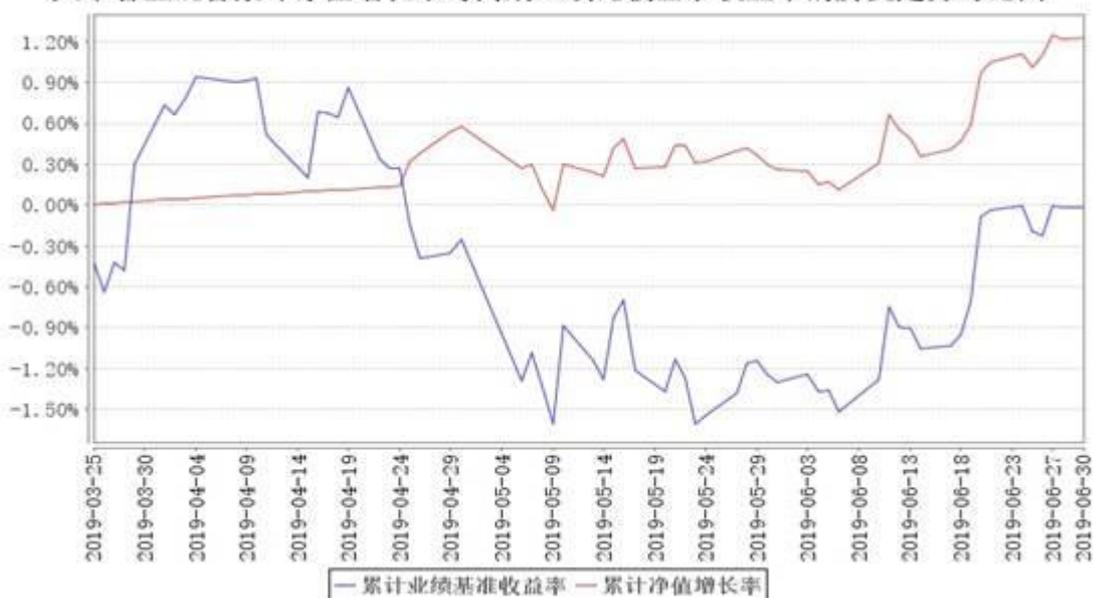
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ (%) | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|-------------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.97% | 0.14% | 1.31% | 0.22% | -0.34% | -0.08% |
| 过去三个月 | 1.20% | 0.12% | -0.32% | 0.29% | 1.52% | -0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.23% | 0.12% | -0.02% | 0.30% | 1.25% | -0.18% |

注：本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 25 日，至本报告期末不满一年。

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、本基金基金合同于 2019 年 3 月 25 日生效，至报告期末不满一年；

2、按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，截至本报告期末本基金尚处于建仓期。

§ 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 83%，中原证券股份有限公司的出资占注册资本的 8.5%，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 7 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、太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------------------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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 | 2019 年 3 月 25 日 | | 9 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，精通化工行业分析。2016 年 4 月加入本公司任研究发展部负责人，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 日起担任太平睿盈混合型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、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 | 2019 年 3 月 25 日 | | 6 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，现任固定收益部基金经理。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。中国国籍。 |
| 陈晓 | 本基金的基金经理、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 | | 9 年 | 南开大学精算学专业硕士学位。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，现任固定收益部投资负责人。2019 年 3 月 29 日起担任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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年以来宏观经济基本保持稳定，一二季度数据出现一定的波动，总体区间仍然保持在宏观调控目标框架内。分季度来看，一季度经济显示出回暖迹象，经济数据略超市场预期，国外经济政治局势发生一定变化，贸易争端有所缓和，市场对于经济预期有所升温。一季度 CPI 较去年比有所上行，主要由食品价格上涨带动。PPI 下行明显，原材料涨价压力较小。央行货币政策维持稳健偏宽松的态势，通过定向降准以及创新使用 TMLF 降低银行融资成本。货币传导机制进一步深化，不断推动宽信用进程，信用风险得到部分缓解。债券市场一季度表现一般，整体呈现震荡行情，市场风险偏好明显提升，权益类资产对债券市场压制明显。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 1.23%，同期业绩比较基准收益率为-0.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观基本面数据在二季度呈现走弱迹象。6 月官方制造业 PMI 为 49.4，与上月持平，持续低于 50 的荣枯线，同时大部分分项指标有恶化趋势。CPI 继续上行，达到 2.70%，为年内新高，果蔬以及猪肉价格的持续上涨给通胀带来一定压力。工业增加值也超预期下滑，叠加月中贸易摩擦，导致月中市场悲观预期升温。资金面 6 月超预期宽松，隔夜资金价格创出近年来新低，但同时也要注意流动性分层现象的加剧，AA 及以下品种融资能力下降明显，银行间质押式回购违约事件上升。债券市场受益于风险偏好下降，利率以及高评级信用债表现抢眼，资金面的宽松导致年内资产收益率下降明显。本基金严格控制权益仓位暴露，在二季度权益市场出现较大回调的情况下实现了较好的投资目标，基金净值回撤较小，实现了超越业绩基准的回报。下半年本基金将继续采用自上而下的资产配置思路，在严格控制风险的前提下，在利率、信用、转债、类现金、权益等可投子资产中灵活切换，争取继续获取超越业绩基准的绝对回报。

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门负责人、量化投资部门负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,744,646.86 |
| 结算备付金 | | 734,225.02 |
| 存出保证金 | | 9,946.86 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 219,134,547.82 |
| 其中：股票投资 | | 23,462,946.56 |
| 基金投资 | | — |
| 债券投资 | | 195,671,601.26 |
| 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 | | — |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 3,442,948.66 |
| 应收股利 | | — |
| 应收申购款 | | — |
| 递延所得税资产 | | — |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | — |
| 资产总计 | | 225,066,315.22 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 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 | | 40,002,868.88 |
| 应付证券清算款 | | 1,438,413.35 |
| 应付赎回款 | | — |

| | | |
|---------------|----------|----------------|
| 应付管理人报酬 | | 85,742.03 |
| 应付托管费 | | 28,580.68 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 37,277.02 |
| 应交税费 | | 10,594.84 |
| 应付利息 | | 22,281.53 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 59,078.32 |
| 负债合计 | | 41,684,836.65 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 181,149,340.25 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 2,232,138.32 |
| 所有者权益合计 | | 183,381,478.57 |
| 负债和所有者权益总计 | | 225,066,315.22 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0123 元，基金份额总额 181,149,340.25 份。

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：2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 |
|------------------------|----------|---|
| | | 2019 年 3 月 25 日(基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 2,991,784.67 |
| 1. 利息收入 | | 1,444,869.57 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 531,054.91 |
| 债券利息收入 | | 804,517.71 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 109,296.95 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -47,939.34 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -253,163.99 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -120,236.00 |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 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 | 325,460.65 |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.17 | 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 | 561,364.57 |
| 减：二、费用 | | 602,776.28 |

| | | |
|---------------------|------------|--------------|
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 283,013.36 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 94,337.77 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 49,327.11 |
| 5. 利息支出 | | 110,128.08 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 110,128.08 |
| 6. 税金及附加 | | 1,592.67 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 64,377.29 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 2,389,008.39 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,389,008.39 |

注：由于本基金于 2019 年 3 月 25 日成立，无上年度可比期间，因此利润表只列示 2019 年 6 月 30 日数据。

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：2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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（净值减少以“-”号填列） | -48,798,568.70 | -156,870.07 | -48,955,438.77 |
| 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 |

注：由于本基金于 2019 年 3 月 25 日成立，无上年度可比期间（下同）。

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>邱宏斌</u> | <u>宋卫华</u> | <u>孙波</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平睿盈混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1582 号《关于准予太平睿盈混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2019]178 号《关于太平睿盈混合型证券投资基金延期募集备案的回函》核准,由太平基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平睿盈混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 229,908,125.22 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0198 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《太平睿盈混合型证券投资基金基金合同》于 2019 年 3 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 229,947,908.95 份基金份额,其中认购资金利息折合 39,783.73 份基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《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 2019 年 8 月 22 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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平睿盈混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 3 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利

润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于

2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 1,744,646.86 |
| 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 个月及以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 1,744,646.86 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|------------------------|----------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 22,763,951.67 | 23,462,946.56 | 698,994.89 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 60,339,790.31 | 56,210.95 |
| | 银行间市场 | 134,997,315.97 | 278,284.03 |

| | | | | |
|--------|----|----------------|----------------|--------------|
| | 合计 | 195,337,106.28 | 195,671,601.26 | 334,494.98 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| | 合计 | 218,101,057.95 | 219,134,547.82 | 1,033,489.87 |

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 2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 2,288.75 |
| 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 | 330.40 |
| 应收债券利息 | 3,440,325.01 |
| 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 | - |
| 其他 | 4.50 |
| 合计 | 3,442,948.66 |

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 2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 31,030.94 |
| 银行间市场应付交易费用 | 6,246.08 |
| 合计 | 37,277.02 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提审计费 | 20,851.46 |
| 预提信息披露费 | 38,226.86 |
| 合计 | 59,078.32 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年3月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 229,947,908.95 | 229,947,908.95 |
| 本期申购 | 50,764,893.28 | 50,764,893.28 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -99,563,461.98 | -99,563,461.98 |
| - 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 | 181,149,340.25 | 181,149,340.25 |

注：1、本基金自2019年2月19日至2019年3月21日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币229,908,125.22元，折合为229,908,125.22份基金份额。根据《太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币39,783.73元在本基金成立后，折合为39,783.73份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《太平睿盈混合型证券投资基金基金合同》、《太平睿盈混合型证券投资基金招募说明书》及《太平睿盈混合型证券投资基金开放日常申购、赎回等业务的公告》的相关规定，本基金于2019年3月25日（基金合同生效日）至2019年4月23日止期间暂不向投资人开放，申购和赎回业务自2019年4月24日起开始办理。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|--------------|--------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,355,518.52 | 1,033,489.87 | 2,389,008.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 59,652.68 | -216,522.75 | -156,870.07 |
| 其中：基金申购款 | 293,503.28 | -215,125.02 | 78,378.26 |
| 基金赎回款 | -233,850.60 | -1,397.73 | -235,248.33 |

| | | | |
|---------|--------------|------------|--------------|
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,415,171.20 | 816,967.12 | 2,232,138.32 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年3月25日（基金合同生效日）至2019 年6月30日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入 | 128,223.38 |
| 定期存款利息收入 | 399,840.28 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 2,974.19 |
| 其他 | 17.06 |
| 合计 | 531,054.91 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年3月25日（基金合同生效日）至2019 年6月30日 |
|------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 9,961,335.08 |
| 减：卖出股票成本总额 | 10,214,499.07 |
| 买卖股票差价收入 | -253,163.99 |

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 2019年3月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日 |
|-----------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期 兑付）成交总额 | 66,578,620.97 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成本总额 | 66,467,529.00 |
| 减：应收利息总额 | 231,327.97 |
| 买卖债券差价收入 | -120,236.00 |

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 2019年3月25日（基金合同生效日）至2019 年6月30日 |
|-------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 325,460.65 |

| | |
|-------------|------------|
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 325,460.65 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2019年3月25日（基金合同生效日）至 2019年6月30日 |
|----------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | 1,033,489.87 |
| 股票投资 | 698,994.89 |
| 债券投资 | 334,494.98 |
| 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 | 1,033,489.87 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年3月25日（基金合同生效日）至2019 年6月30日 |
|---------|--|
| 基金赎回费收入 | 561,364.57 |
| 合计 | 561,364.57 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年3月25日（基金合同生效日）至2019 年6月30日 |
|-----------|--|
| 交易所市场交易费用 | 45,109.61 |
| 银行间市场交易费用 | 4,217.50 |
| 合计 | 49,327.11 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年3月25日（基金合同生效日）至2019 年6月30日 |
|-------|--|
| 审计费用 | 20,851.46 |
| 信息披露费 | 38,226.86 |

| | |
|-----------|-----------|
| 银行划款手续费 | 4,898.97 |
| 上市年费 | - |
| 债券托管账户维护费 | - |
| 指数使用费 | - |
| 红利手续费 | - |
| 开户费 | 400.00 |
| 合计 | 64,377.29 |

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

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|-------------------|
| 太平基金管理有限公司（“太平基金”） | 基金管理人、基金销售机构、登记机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人 |
| 太平资产管理有限公司（“太平资管”） | 基金管理人的股东 |
| 中原证券股份有限公司（“中原证券”） | 基金管理人的股东 |
| 安石投资管理有限公司（“安石投资”） | 基金管理人的股东 |

注：下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 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 | 283,013.36 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 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 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 | 94,337.77 |

注：支付基金托管人交通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。

6.4.10.3 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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 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 |
| 招商银行股份有限公司 | 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，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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(2019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

| 6.4.12.1.2 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 |
| 113028 | 环境转债 | 2019-06-19 | 2019-07-08 | 新债确认 | 100.00 | 100.00 | 460 | 46,000.00 | 46,000.00 | 网下申购 |

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 2019 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 7,409,868.88 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 | 数量（张） | 期末估值总 |
|------|------|-------|-------|-------|-------|
|------|------|-------|-------|-------|-------|

| | | | 价 | | 额 |
|-----------|---------------|----------------|--------|--------|--------------|
| 071900051 | 19 中信建投 CP003 | 2019 年 7 月 2 日 | 100.09 | 78,000 | 7,807,020.00 |
| 合计 | | | | 78,000 | 7,807,020.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2019 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 32,593,000 元，于 2019 年 12 月 27 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 2019年6月30日 |
|--------|-------------------|
| A-1 | 23,023,100.00 |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | - |
| 合计 | 23,023,100.00 |

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，本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，本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 2019年6月30日 |
|--------|-------------------|
| AAA | 156,035,360.86 |
| AAA 以下 | 1,475,140.40 |
| 未评级 | 15,138,000.00 |
| 合计 | 172,648,501.26 |

注：未评级债券为政策性金融债。

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，本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，本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 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 28,757,868.88 元将在一个月以内到期且计息、5,133,000.00 元将在一至三个月以内到期且计息、6,112,000.00 元将在三个月至一年以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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上市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 2019 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 0.00%。

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 2019 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 224,322,143.34 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。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2019 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 | 1,744,646.86 | - | - | - | - | - | -1,744,646.86 |
| 结算备付金 | 734,225.02 | - | - | - | - | - | 734,225.02 |
| 存出保证金 | 9,946.86 | - | - | - | - | - | 9,946.86 |
| 交易性金融资产 | - | 23,023,100.00 | 15,138,000.00 | 147,498,433.90 | 10,012,067.36 | 23,462,946.56 | 219,134,547.82 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 3,442,948.66 | 3,442,948.66 |

| | | | | | | | |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 资产总计 | 2,488,818.74 | 23,023,100.00 | 15,138,000.00 | 147,498,433.90 | 10,012,067.36 | 26,905,895.22 | 225,066,315.22 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 85,742.03 | 85,742.03 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 28,580.68 | 28,580.68 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 1,438,413.35 | 1,438,413.35 |
| 卖出回购金融资产款 | 28,757,868.88 | 5,133,000.00 | 6,112,000.00 | - | - | - | 40,002,868.88 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 37,277.02 | 37,277.02 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | 10,594.84 | 10,594.84 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 22,281.53 | 22,281.53 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 59,078.32 | 59,078.32 |
| 负债总计 | 28,757,868.88 | 5,133,000.00 | 6,112,000.00 | - | - | 1,681,967.77 | 41,684,836.65 |
| 利率敏感度缺口 | -26,269,050.14 | 17,890,100.00 | 9,026,000.00 | 147,498,433.90 | 10,012,067.36 | 25,223,927.45 | 183,381,478.57 |

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（2019年6月30日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 969,287.73 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -959,926.42 |

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中：股票资产占基金资产的比例为 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，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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，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 2019 年 6 月 30 日 | |
|---------------|------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 23,462,946.56 | 12.79 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 195,671,601.26 | 106.70 |
| 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 | 219,134,547.82 | 119.50 |

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 (2019 年 6 月 30 日) |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 1,103,513.03 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -1,103,513.03 |

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 219,134,547.82 元，无属于第一或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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 | 23,462,946.56 | 10.42 |
| | 其中：股票 | 23,462,946.56 | 10.42 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 195,671,601.26 | 86.94 |
| | 其中：债券 | 195,671,601.26 | 86.94 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,478,871.88 | 1.10 |
| 8 | 其他各项资产 | 3,452,895.52 | 1.53 |
| 9 | 合计 | 225,066,315.22 | 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

| 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 | 1,719,752.55 | 0.94 |
| C | 制造业 | 7,030,046.45 | 3.83 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 747,500.00 | 0.41 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| F | 批发和零售业 | 427,350.00 | 0.23 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,613,977.80 | 0.88 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,390,603.76 | 0.76 |
| J | 金融业 | 6,816,820.00 | 3.72 |
| K | 房地产业 | 2,931,996.00 | 1.60 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 475,200.00 | 0.26 |
| 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 | 309,700.00 | 0.17 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 23,462,946.56 | 12.80 |

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 | 600048 | 保利地产 | 150,000.00 | 1,914,000.00 | 1.04 |
| 2 | 000001 | 平安银行 | 90,000.00 | 1,240,200.00 | 0.68 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 12,000.00 | 1,063,320.00 | 0.58 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 25,300.00 | 1,049,950.00 | 0.57 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 20,000.00 | 1,037,200.00 | 0.57 |
| 6 | 600377 | 宁沪高速 | 93,200.00 | 1,000,968.00 | 0.55 |
| 7 | 002271 | 东方雨虹 | 40,000.00 | 906,400.00 | 0.49 |
| 8 | 002035 | 华帝股份 | 70,000.00 | 852,600.00 | 0.46 |
| 9 | 601225 | 陕西煤业 | 91,700.00 | 847,308.00 | 0.46 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 60,000.00 | 813,000.00 | 0.44 |
| 11 | 002332 | 仙琚制药 | 120,000.00 | 811,200.00 | 0.44 |
| 12 | 601328 | 交通银行 | 130,000.00 | 795,600.00 | 0.43 |
| 13 | 601398 | 工商银行 | 130,000.00 | 765,700.00 | 0.42 |
| 14 | 601818 | 光大银行 | 200,000.00 | 762,000.00 | 0.42 |
| 15 | 600188 | 兖州煤业 | 70,000.00 | 760,900.00 | 0.41 |
| 16 | 601668 | 中国建筑 | 130,000.00 | 747,500.00 | 0.41 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|------------|------|
| 17 | 601939 | 建设银行 | 100,000.00 | 744,000.00 | 0.41 |
| 18 | 000581 | 威孚高科 | 40,000.00 | 742,400.00 | 0.40 |
| 19 | 600919 | 江苏银行 | 100,000.00 | 726,000.00 | 0.40 |
| 20 | 601288 | 农业银行 | 200,000.00 | 720,000.00 | 0.39 |
| 21 | 002120 | 韵达股份 | 19,890.00 | 613,009.80 | 0.33 |
| 22 | 000895 | 双汇发展 | 24,500.00 | 609,805.00 | 0.33 |
| 23 | 000002 | 万科A | 20,000.00 | 556,200.00 | 0.30 |
| 24 | 002439 | 启明星辰 | 20,000.00 | 538,000.00 | 0.29 |
| 25 | 300012 | 华测检测 | 44,000.00 | 475,200.00 | 0.26 |
| 26 | 300702 | 天宇股份 | 13,000.00 | 468,520.00 | 0.26 |
| 27 | 601155 | 新城控股 | 11,600.00 | 461,796.00 | 0.25 |
| 28 | 002727 | 一心堂 | 15,000.00 | 427,350.00 | 0.23 |
| 29 | 300015 | 爱尔眼科 | 10,000.00 | 309,700.00 | 0.17 |
| 30 | 002508 | 老板电器 | 10,000.00 | 271,400.00 | 0.15 |
| 31 | 002594 | 比亚迪 | 5,000.00 | 253,600.00 | 0.14 |
| 32 | 600968 | 海油发展 | 31,421.00 | 111,544.55 | 0.06 |
| 33 | 601698 | 中国卫通 | 10,103.00 | 39,603.76 | 0.02 |
| 34 | 603867 | 新化股份 | 1,045.00 | 26,971.45 | 0.01 |

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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------------|----------------|
| 1 | 600048 | 保利地产 | 1,952,379.00 | 1.06 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 1,523,900.00 | 0.83 |
| 3 | 600188 | 兖州煤业 | 1,143,566.00 | 0.62 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 1,078,910.00 | 0.59 |
| 5 | 000001 | 平安银行 | 1,078,200.00 | 0.59 |
| 6 | 601818 | 光大银行 | 1,070,360.00 | 0.58 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 1,057,440.00 | 0.58 |
| 8 | 601998 | XD 中信银 | 1,014,400.00 | 0.55 |
| 9 | 600585 | 海螺水泥 | 1,012,844.00 | 0.55 |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 1,011,880.00 | 0.55 |
| 11 | 601328 | 交通银行 | 1,011,360.00 | 0.55 |
| 12 | 601288 | 农业银行 | 1,007,100.00 | 0.55 |
| 13 | 601169 | 北京银行 | 1,004,800.00 | 0.55 |
| 14 | 601225 | 陕西煤业 | 1,001,790.00 | 0.55 |
| 15 | 600377 | 宁沪高速 | 1,000,050.00 | 0.55 |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 999,436.00 | 0.55 |
| 17 | 600919 | 江苏银行 | 998,730.00 | 0.54 |
| 18 | 600383 | 金地集团 | 971,600.00 | 0.53 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 19 | 601166 | 兴业银行 | 963,587.00 | 0.53 |
| 20 | 300059 | 东方财富 | 811,600.00 | 0.44 |

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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|------------|----------------|
| 1 | 601169 | 北京银行 | 958,400.00 | 0.52 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 937,250.00 | 0.51 |
| 3 | 601998 | XD 中信银 | 929,600.00 | 0.51 |
| 4 | 600383 | 金地集团 | 923,718.08 | 0.50 |
| 5 | 601939 | 建设银行 | 776,100.00 | 0.42 |
| 6 | 600588 | 用友网络 | 451,180.00 | 0.25 |
| 7 | 002415 | 海康威视 | 417,474.00 | 0.23 |
| 8 | 300122 | 智飞生物 | 412,787.00 | 0.23 |
| 9 | 000672 | 上峰水泥 | 410,727.00 | 0.22 |
| 10 | 603986 | 兆易创新 | 406,700.00 | 0.22 |
| 11 | 300349 | 金卡智能 | 403,260.00 | 0.22 |
| 12 | 603019 | 中科曙光 | 328,500.00 | 0.18 |
| 13 | 600188 | 兖州煤业 | 319,490.00 | 0.17 |
| 14 | 000429 | 粤高速 A | 305,200.00 | 0.17 |
| 15 | 601398 | 工商银行 | 270,720.00 | 0.15 |
| 16 | 600919 | 江苏银行 | 266,770.00 | 0.15 |
| 17 | 601668 | 中国建筑 | 266,020.00 | 0.15 |
| 18 | 601288 | 农业银行 | 263,900.00 | 0.14 |
| 19 | 601328 | 交通银行 | 230,660.00 | 0.13 |
| 20 | 601818 | 光大银行 | 223,440.00 | 0.12 |

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 | 32,978,450.74 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 9,961,335.08 |

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 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 35,358,000.00 | 19.28 |
| | 其中：政策性金融债 | 15,138,000.00 | 8.25 |
| 4 | 企业债券 | 28,642,000.00 | 15.62 |
| 5 | 企业短期融资券 | 23,023,100.00 | 12.55 |
| 6 | 中期票据 | 97,114,500.00 | 52.96 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 11,364,135.66 | 6.20 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 169,865.60 | 0.09 |
| 10 | 合计 | 195,671,601.26 | 106.70 |

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 | 150410 | 15 农发 10 | 150,000 | 15,138,000.00 | 8.25 |
| 2 | 071900044 | 19 中信 CP006BC | 120,000 | 12,013,200.00 | 6.55 |
| 3 | 071900051 | 19 中信建投 CP003 | 110,000 | 11,009,900.00 | 6.00 |
| 4 | 101754105 | 17 河钢集 MTN014 | 100,000 | 10,509,000.00 | 5.73 |
| 5 | 143475 | 18 建材 01 | 100,000 | 10,314,000.00 | 5.62 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体或其分支机构中，平安银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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

7.12.2

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 9,946.86 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,442,948.66 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,452,895.52 |

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 | 110045 | 海澜转债 | 1,288,818.00 | 0.70 |
| 2 | 110041 | 蒙电转债 | 670,500.00 | 0.37 |

| | | | | |
|---|--------|----------|------------|------|
| 3 | 132011 | 17 浙报 EB | 188,800.00 | 0.10 |
|---|--------|----------|------------|------|

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

| 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 (%) |
| 317 | 571,449.02 | 179,940,263.83 | 99.33 | 1,209,076.42 | 0.67 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 8,577.43 | 0.005 |

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 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------------|----------------|
| 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 | 229,947,908.95 |
| 本报告期基金总申购份额 | 50,764,893.28 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 99,563,461.98 |
| 本报告期基金拆分变动份额 (份额减少 以“-”填列) | - |

| | |
|-------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 181,149,340.25 |
|-------------|----------------|

§ 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、基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内本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 | 2 | 42,831,18 | 100.00% | 31,030.94 | 100% | - |

| | | | | | | |
|------------|--|------|--|--|--|--|
| 股份有限 公司 | | 3.77 | | | | |
|------------|--|------|--|--|--|--|

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

本期无券商交易单元变更的情况。

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 | 60,299,157.65 | 100.00% | 511,093,000.00 | 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 | 太平睿盈混合型证券投资基金基金合同生效公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019年3月26日 |
| 2 | 太平基金管理有限公司太平基金管理有限公司关于增聘陈晓担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 | 2019年3月30日 |
| 3 | 太平睿盈混合型证券投资基金开放日常申购、赎回等业务的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019年4月23日 |
| 4 | 太平睿盈混合型证券投资基金开放转换业务公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019年6月6日 |
| 5 | 太平基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告 | 指定报刊、基金管理人网站 | 2019年6月21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 | 20190325——20190630 | 50,008,000.00 | - | - | 50,008,000.00 | 27.61 |
| 机构 | 2 | 20190325——20190630 | 30,004,400.00 | 49,924,113.83 | - | 79,928,513.83 | 44.12 |
| 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：021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司
二〇一九年八月二十四日