

# 太平睿安混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	8
2.4 信息披露方式 .....	8
2.5 其他相关资料 .....	9
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	9
3.2 基金净值表现 .....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	13
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	15
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 .....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	18
4.10 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 .....	19
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	19
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 .....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	19
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	19
6.2 审计报告的基本内容 .....	19
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表 .....	21
7.2 利润表 .....	23
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	24
7.4 报表附注 .....	27
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>62</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	62

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	68
8.12 投资组合报告附注 .....	68
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>70</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	70
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>71</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>71</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	71
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
11.4 基金投资策略的改变 .....	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
11.8 其他重大事件 .....	75
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	太平睿安混合型证券投资基金	
基金简称	太平睿安混合	
基金主代码	010268	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 10 日	
基金管理人	太平基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	399,713,295.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C
下属分级基金的交易代码	010268	010269
报告期末下属分级基金的份额总额	375,817,628.07 份	23,895,667.81 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	追求在严格控制风险的前提下，通过资产配置和灵活运用多种投资策略，争取高于业绩收益比较基准的投资收益。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取主动投资管理的投资模式。在深入研究国内外的宏观经济走势，跟踪资产市场环境变化，通过“自上而下”的资产配置及动态调整策略，将基金资产在各类型证券上进行灵活配置。其中，当权益市场资产价格明显上涨时，适当增加权益类资产配置比例；当权益市场处于下行周期且市场风险偏好下降时，适当增加固定收益类资产配置比例，并通过灵活运用衍生品合约的套期保值与对冲功能，最终力求实现基金资产组合收益的最大化，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本管理人将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对资产组合进行积极管理。</p> <p>（1）利率策略</p> <p>本基金研究 GDP、物价、就业、国际收支等国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。</p> <p>组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变</p>

化趋势的预期，综合宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，可以制定出组合的目标久期，预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期，以规避债券价格下降的风险和资本损失，获得较高的再投资收益；预期市场利率将下降时，提高组合的久期，在市场利率实际下降时获得债券价格上升的收益，并获得较高利息收入。

#### （2）期限配置策略

在短期利率期限结构分析的基础上，根据对投资对象流动性和收益性的动态考察，构建合理期限结构的投资组合。从组合总的剩余期限结构来看，一般说来，预期利率上涨时，将适当缩短组合的平均剩余期限；预期利率下降时，将在法律法规允许的范围内适当延长组合的平均剩余期限。

#### （3）信用债投资策略

本基金所指信用债包括：金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债和中期票据等除国债、央行票据和政策性金融债之外的、非国家信用担保的固定收益类金融工具。

本基金投资于同业存单的比例不得超过基金资产的 20%，并且不得投资于信用评级低于 AA+ 的信用债，其中投资于 AA+ 评级信用债的比例不超过信用债资产总值的 50%，投资于 AAA 评级信用债的比例占信用债资产总值的 50%-100%。

金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、企业债、公司债、资产支持证券、次级债和中期票据等信用债的信用评级依照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级；短期融资券和超短期融资券等信用债的信用评级依照基金管理人选定评级机构出具的主体信用评级。

信用债券相对国债等利率产品的信用利差是获取较高投资收益的来源，本基金将通过重点投资信用类债券，提高整体收益能力。本管理人在内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下，积极投资信用债券，获取信用利差带来的高投资收益。

债券的信用利差主要受两个方面的影响，一是市场信用利差曲线的走势；二是债券本身的信用变化。本基金通过对宏观经济走势、行业信用状况、信用债券市场流动性风险、信用债券供需情况等分析，判断市场信用利差曲线整体及分行业走势，确定各类属信用债券的投资比例。依靠内部评级系统分析各信用债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债券进行投资。

#### （4）中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债具有票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差等特点。因此本基金审慎投资中小企业私募债券。

针对市场系统性信用风险，本基金主要通过调整中小企业私募债类属资产的配置比例，谋求避险增收。

针对非系统性信用风险，本基金通过分析发债主体的信用水平及个债增信措施，量化比较判断估值，精选个债，谋求避险增收。

本基金主要采取买入持有到期策略；当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取“尽早出售”策略，控制投资风险。

另外，部分中小企业私募债内嵌转股选择权，本基金将通过深入的基本面分析及定性定量研究，自下而上地精选个债，在控制风险的前提下，谋求内嵌转股权潜在的增强收益。

### 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。

#### 1) 公司质量评估

在对行业进行充分评估的基础上，深入调研上市公司，基于公司竞争优势、发展战略、治理结构、管理水平和估值比较等关键因素，预测中长期发展前景，重点关注上市公司的成长性和核心竞争力。从以下几个方面进行分析：

公司所处行业前景：所处行业具有良好的发展趋势；行业规模、行业景气周期、竞争格局等方面有利于公司持续提升市占率和盈利能力。

公司核心竞争力：公司在生产、技术、市场、创新、资源、品牌等一个或多个方面占据领先地位或具有显著的成长性，能够保持竞争优势。

公司治理结构：公司管理层稳定、高效，具有良好的战略视野和执行能力，并能根据形势的变化灵活地做出调整和应对等。

公司盈利能力：公司具有良好的财务结构、资产状况、盈利指标、成本管控能力、现金流特征，经营和发展具有长期可持续性。

#### 2) 价值评估

本基金将结合市场阶段特点及行业特征，选取相应的相对估值指标（如 P/B、P/E、EV/EBITDA、PEG、PS 等）和绝对估值指标（如 DCF、NAV、FCFF、DDM、EVA 等）对上市公司进行估值分析，精选财务健康、持续成长、估值存在提升空间的股票。

#### 3) 新股申购策略

本基金将深入研究首次公开发行股票或增发新股的上市公司基本面，根据股票市场整体估值水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，制定相应的新股申购策略。

本基金还将结合研究员的实地调查研究，并按照投资决策程序，构建本基金的股票投资组合并进行动态调整。

### 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

	<p>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，当现货全部平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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵霖
	联系电话	021-38556613
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn
客户服务电话	021-61560999/400-028-8699	95561
传真	021-38556677	021-62159217
注册地址	上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200120	200120
法定代表人	焦艳军	吕家进

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn

基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼
------------	-----------------------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼
注册登记机构	太平基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年 11 月 10 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	
	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C
本期已实现收益	-55,556,264.22	-1,883,031.88	60,193,002.45	2,961,121.60	1,948,859.30	410,795.85
本期利润	-91,970,912.31	-4,012,581.25	50,964,224.46	2,449,834.95	8,645,453.15	1,543,397.81
加权平均基金份额本期利润	-0.1818	-0.2320	0.0847	0.0791	0.0321	0.0224
本期加权平均净值利润率	-18.49%	-23.73%	7.92%	7.46%	3.19%	2.23%
本期基金份额净值增长率	-11.31%	-11.76%	8.48%	7.95%	3.04%	2.97%
3.1.2 期末数	2022 年末		2021 年末		2020 年末	

据和指标						
期末可供分配利润	-21,479,880.93	-1,607,179.98	41,563,679.58	1,213,301.58	2,302,175.14	301,113.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0572	-0.0673	0.0605	0.0541	0.0070	0.0063
期末基金资产净值	356,750,592.93	22,438,527.79	735,806,373.55	23,850,247.35	338,101,923.33	49,076,488.59
期末基金份额净值	0.9493	0.9390	1.0704	1.0641	1.0304	1.0297
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	-0.86%	-1.91%	11.78%	11.15%	3.04%	2.97%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

太平睿安混合 A

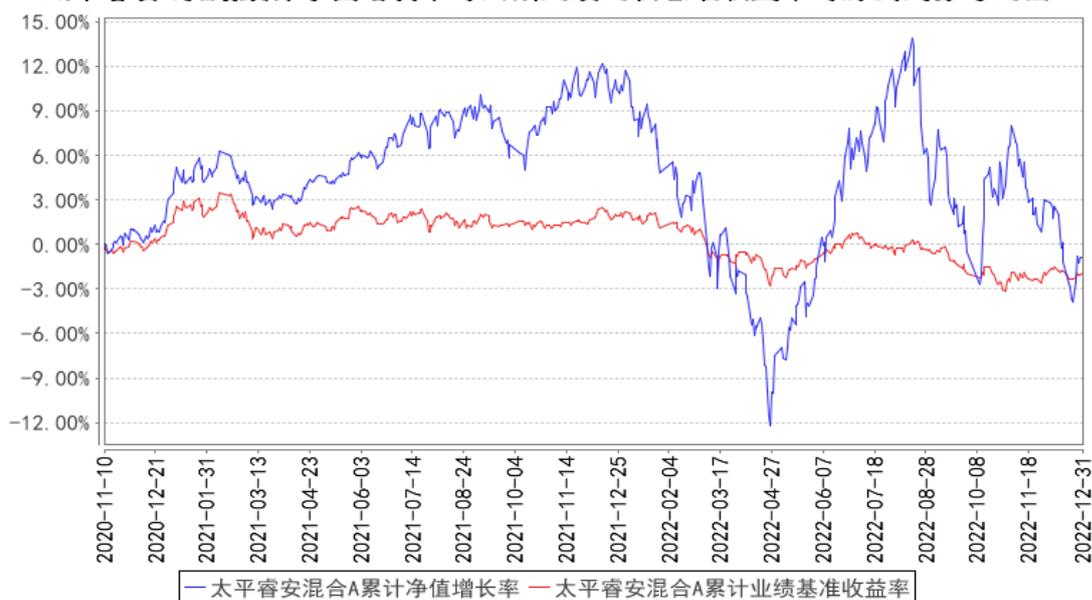
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.32%	1.05%	-0.05%	0.25%	-0.27%	0.80%
过去六个月	-6.87%	1.07%	-2.68%	0.21%	-4.19%	0.86%
过去一年	-11.31%	1.10%	-4.06%	0.26%	-7.25%	0.84%
自基金合同生效 起至今	-0.86%	0.82%	-1.97%	0.24%	1.11%	0.58%

太平睿安混合 C

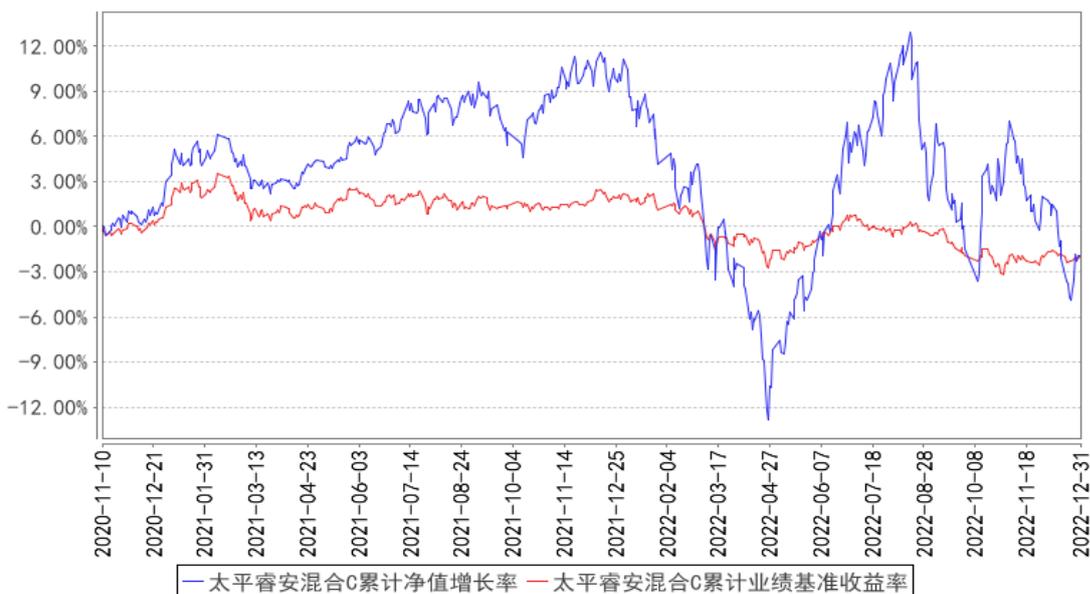
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.45%	1.05%	-0.05%	0.25%	-0.40%	0.80%
过去六个月	-7.10%	1.07%	-2.68%	0.21%	-4.42%	0.86%
过去一年	-11.76%	1.10%	-4.06%	0.26%	-7.70%	0.84%
自基金合同生效 起至今	-1.91%	0.82%	-1.97%	0.24%	0.06%	0.58%

### 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

太平睿安混合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



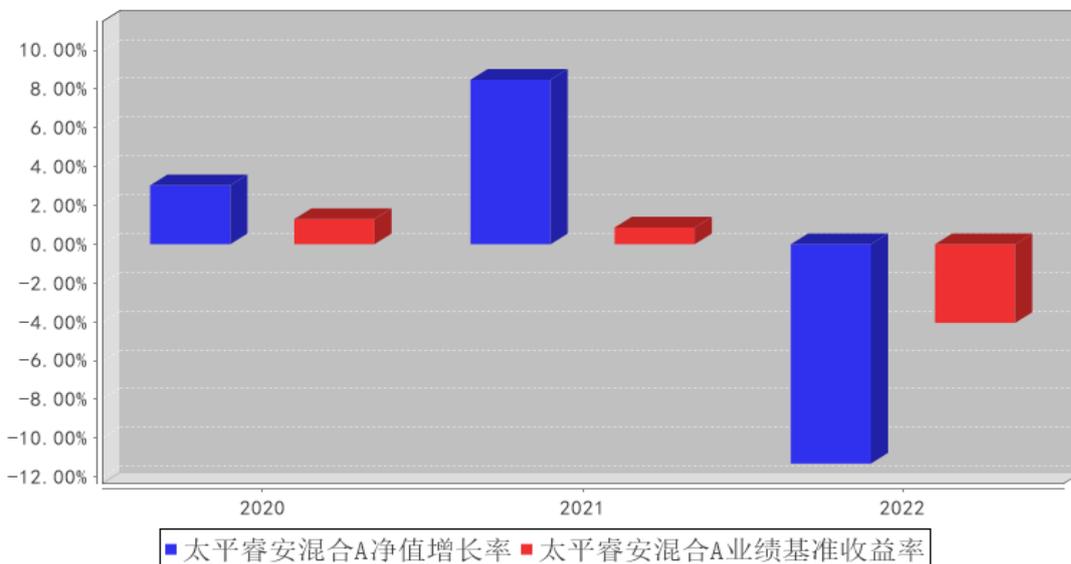
太平睿安混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



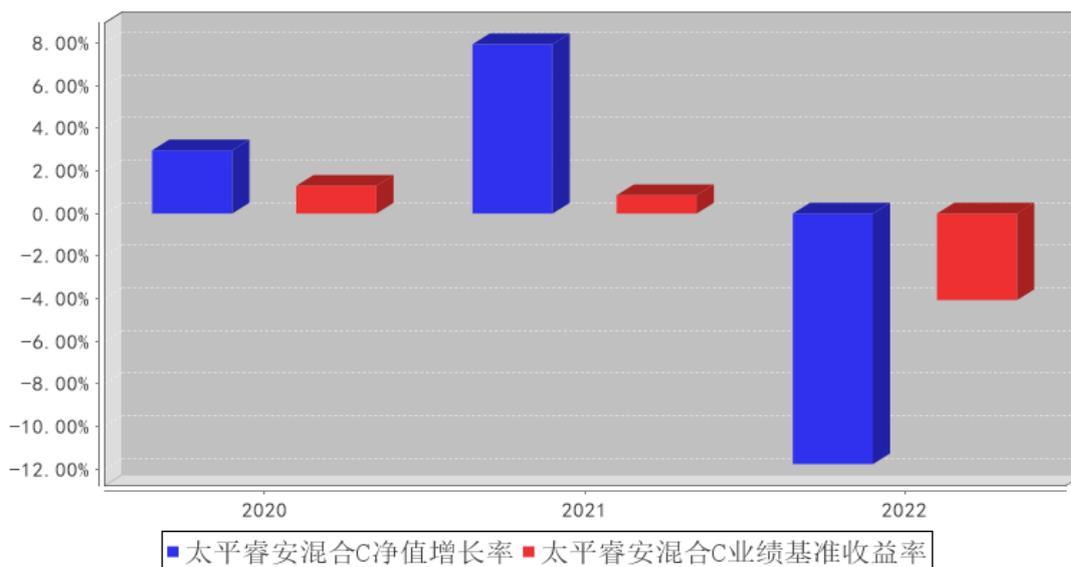
注：本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 10 日，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2020 年 11 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

太平睿安混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



太平睿安混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 10 日，至本报告期末未满 5 年。

2、合同生效按当年实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

太平睿安混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
2021 年	0.4700	15,660,044.14	15,938,755.79	31,598,799.93	-
2020 年	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
合计	0.4700	15,660,044.14	15,938,755.79	31,598,799.93	-

太平睿安混合 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
2021 年	0.4700	335,890.58	686,457.04	1,022,347.62	-
2020 年	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
合计	0.4700	335,890.58	686,457.04	1,022,347.62	-

## § 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，2016 年 8 月 22 日更名为太平基金管理有限公司。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等。公司遵循诚信、规范的经营方针，倡导求实、高效的管理作风。注重风险控制，秉持价值投资的理念，通过科学合理的资产配置策略，为基金持有人提供优质的投资和资产管理服务。截至本报告期末，公司共管理 30 只证券投资基金。

#### 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		
陈晓	固定收益投资部总监、本基金的基金经理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理、太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、太平睿享混合型证券投资基金基金经理、	2020 年 11 月 10 日	-	12 年	南开大学精算学专业经济学硕士。2010 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任投资部研究助理、固定收益研究员、固定收益高级研究员。2014 年 1 月先后担任光大保德信增利收益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信信用添益债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安和债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安祺债券型证券投资基金基金经理、光大保德信安诚债券型证券投资基金基金经理、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金基金经理、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金基金经理。2018 年 11 月加入太平基金管理有限公司，现任固定收益投资部总监。2019 年 3 月 29 日至 2020 年 4 月 15 日担任太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理。2019 年 3 月 29 日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2020 年 9 月 17 日起担任太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 10 日起担任太平睿安混合型证券投资基金基金经理。2021 年 4 月 22 日起担任太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 17 日起担任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。2021 年 12 月 21 日起担任太平睿庆混合型证券投资基金基金经理。2022 年 5 月 5 日起担任太平安元债券

	太平睿庆混合型证券投资基金基金经理、太平洋安元债券型证券投资基金				型证券投资基金基金经理。
邵闯	本基金的基金经理助理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理助理	2020 年 11 月 10 日	-	5 年	上海交通大学工程硕士，具有证券投资基金从业资格。2017 年 4 月起在光大证券研究所从事研究分析工作。2020 年 3 月加入本公司，2020 年 9 月 10 日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理助理。2020 年 11 月 10 日起担任太平睿安混合型证券投资基金基金经理助理。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期一般情况下根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

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

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

督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年期间，国内外发生了很多重要事件，持续影响着国内外经济发展和金融市场走势。其中，俄乌冲突年初爆发，不仅改变了全球地缘政治走向，也影响了国际能源供需格局；疫情逐步趋于缓和，但其过程仍然对包括中国在内的诸多经济体带来了影响。二十大胜利召开，为我们指明前进方向，通过高质量发展和科技创新来解决质的问题，在质的大幅提升中实现量的持续增长。

2022 年权益市场和债券市场都经历了波动并出现回撤。2022 年全年上证指数回落 15.1%，结束了连续三年的上涨行情。在估值贡献和盈利贡献方面，A 股遭遇戴维斯双杀，上市公司盈利增速大幅下降，估值整体收缩。在板块风格上方面，A 股全年呈现快速轮动，新能源、半导体、军工、信创、医药等成长行业，虽然阶段性表现亮眼，但回顾全年表现，还是以煤炭为首的行业，价值表现相对较好。

2022 年债券市场前十个月表现相对稳定，考虑到国内经济受疫情反复的影响，资本市场整体风险偏好较低，债券收益率波动较小；同时受益于资金价格较低，债券市场在此期间整体表现较好。但从 11 月开始，由于地产支持政策接连出台，疫情防控政策逐步改善，资本市场整体风险偏好有所提升，从而使得债券市场出现了下行调整，同时再叠加机构理财产品的赎回，两项因素相互影响形成了循环效应，致使债券市场在当年最后两个月期间出现了较大幅度的回撤。

本组合今年净值回撤较大，主要由于权益和可转债仓位较高，在上半年净值下行较多，在 5-6 月主动调整持仓结构，在二季度后半段和三季度初取得了不错的效果。但三四季度市场再度大幅下挫，导致组合净值再度下跌。本报告期内，本基金仍然坚持在权益较高仓位情况下寻求超额收益。权益部分，持仓结构相对均衡偏成长风格，着重控制整体估值水平，降低组合收益不确定性，后续加强行业和个股研究，力争在风险可控的基础上增加收益。可转债部分，持仓标的整体价格和溢价水平不高，后续自下而上精选个券，力争获取超额收益。整体上本基金力争利用不同板块的股票、可转债、债券协调优化大类资产配置，积极捕捉市场机会，力争为投资人取得较好的风险收益比。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平睿安 A 的份额净值增长率为-11.31%，同期业绩比较基准收益率为-4.06%。太平睿安 C 的份额净值增长率为-11.76%，同期业绩比较基准收益率为-4.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年，内部经济处于疫情后的修复通道中，中央经济会议也提出要大力提振市场信心，财政政策继续发力，货币政策维持偏宽松环境，流动性仍然相对充裕。同时地产政策不断推出，发力促进房地产市场企稳，但后续仍需观察房地产销售情况的改善程度。外部环境，一方面俄乌冲突仍未结束，不排除继续发酵的可能，另一方面海外加息、高利率环境预计将维持一段时间，虽然美联储近期加息幅度有所放缓，但仍存在一定的反复风险，届时不仅会对欧美经济产生一定的负面作用，同时也会对新兴市场的外需产生一定的影响。

针对资本市场，经济总体向上复苏，企业盈利也将走出疫情影响逐步复苏，并驱动 A 股股市重拾向上趋势。外部环境、内部利率变化也将对 A 股的走势节奏和幅度产生影响。方向上二十大报告指明未来的核心思路，A 股从重视龙头、高现金流的投资思路，在经历了两年相对混乱的结构之后，有望围绕科技自立自强、安全发展、高端制造、硬科技、专精特新五个关键词构建新的选股思路。重点方向总结为高端制造、医疗医药、新能源、自主可控、军工装备。

债券市场而言，相较于前两年当前经济处于复苏低点，需要宽松的货币政策环境呵护，债市或将仍以宽幅震荡为主基调。若后续经济明显复苏后出现了一定的通胀压力，则债券市场则会面临一定的调整压力。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

在内控制度建设方面，公司持续完善内控制度建设，并时刻关注法规的新变化、结合行业发

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

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

报告期内，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金资产的估值核算办法》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值与产品委员会下设估值分委会，常任委员由稽核风控部、投资部门、研究部、基金运营部等部门负责人担任。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2302237 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	太平睿安混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的太平睿安混合型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2022 年 12 月 31 日的

	财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人太平基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2022 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,</p>

	<p>未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张楠   李晨宇
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼
审计报告日期	2023 年 03 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：太平睿安混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,031,155.42	3,318,479.10
结算备付金		538,212.29	3,343,360.72
存出保证金		79,251.62	144,754.67
交易性金融资产	7.4.7.2	373,365,281.25	980,337,501.68
其中：股票投资		151,117,425.75	299,884,250.70
基金投资		-	-
债券投资		222,247,855.50	680,453,250.98
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-9,685.20	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		48,037,579.20	4,341,738.03
应收股利		-	-
应收申购款		244.76	254.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	6,736,207.68
资产总计		425,042,039.34	998,222,296.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	233,034,531.45
应付清算款		-	4,464,515.83
应付赎回款		45,247,048.66	-
应付管理人报酬		217,957.73	392,933.51
应付托管费		36,326.26	65,488.94
应付销售服务费		9,989.25	10,168.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,329.57	14,132.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	339,267.15	583,905.48
负债合计		45,852,918.62	238,565,675.67
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	399,713,295.88	709,812,550.75
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-20,524,175.16	49,844,070.15
净资产合计		379,189,120.72	759,656,620.90
负债和净资产总计		425,042,039.34	998,222,296.57

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，太平睿安混合 A 份额净值 0.9493 元，基金份额总额 375,817,628.07 份，太平睿安混合 C 份额净值 0.9390 元，基金份额总额 23,895,667.81 份，总份额合计 399,713,295.88 份。

## 7.2 利润表

会计主体：太平睿安混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-90,838,112.62	64,732,917.87
1. 利息收入		108,293.92	19,095,126.18
其中：存款利息收入	7.4.7.13	55,983.15	80,847.64
债券利息收入		-	18,989,757.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		52,310.77	24,520.58
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-52,496,139.88	55,312,398.77
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-56,220,161.48	38,482,159.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	2,180,463.83	13,975,350.46
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,543,557.77	2,854,888.46
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-38,544,197.46	-9,740,064.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	93,930.80	65,457.56
<b>减：二、营业总支出</b>		5,145,380.94	11,318,858.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,107,218.56	4,054,026.76
2. 托管费	7.4.10.2.2	517,869.78	675,671.20
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	84,627.49	165,077.74
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,231,618.76	4,368,464.10

其中：卖出回购金融资产支出		1,231,618.76	4,368,464.10
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,672.80	13,086.29
8. 其他费用	7.4.7.23	199,373.55	2,042,532.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-95,983,493.56	53,414,059.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-95,983,493.56	53,414,059.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-95,983,493.56	53,414,059.41

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：太平睿安混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	709,812,550.75	-	49,844,070.15	759,656,620.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	709,812,550.75	-	49,844,070.15	759,656,620.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-310,099,254.87	-	-70,368,245.31	-380,467,500.18
(一)、综合收	-	-	-95,983,493.56	-95,983,493.56

益总额				
(二)、 本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-310,099,254.87	-	25,615,248.25	-284,484,006.62
其中:1.基金申购款	61,634,244.54	-	1,991,051.70	63,625,296.24
2.基金赎回款	-371,733,499.41	-	23,624,196.55	-348,109,302.86
(三)、 本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	399,713,295.88	-	-20,524,175.16	379,189,120.72
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基	375,784,875.64	-	11,393,536.28	387,178,411.92

金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	375,784,875.64	-	11,393,536.28	387,178,411.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	334,027,675.11	-	38,450,533.87	372,478,208.98
(一)、综合收益总额	-	-	53,414,059.41	53,414,059.41
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	334,027,675.11	-	17,657,622.01	351,685,297.12
其中:1.基金申购款	438,422,685.29	-	25,801,595.62	464,224,280.91
2.基金赎回款	-104,395,010.18	-	-8,143,973.61	-112,538,983.79
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-32,621,147.55	-32,621,147.55

金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	709,812,550.75	-	49,844,070.15	759,656,620.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>范宇</u>	<u>邓先虎</u>	<u>王瑞瑾</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

太平睿安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[2020]2096号《关于准予太平睿安混合型证券投资基金注册的批复》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《太平睿安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 347,008,876.56 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(2020)第 0921 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《太平睿安混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 11 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 347,016,463.55 份基金份额,其中认购资金利息折合 7,586.99 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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。根据《太平睿安混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费用、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。在投资人认购/申购时收取前端认购/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;在投资者认购/申购时不收取前端认购/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《太平睿安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)、衍生工具(股指期货、国债期货等)、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、超短期融资券、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：股票投资占基金资产的比例为 0%-40%；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。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后,对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后,对于该类金融资产以公允价值进行后续计量,产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益,除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后,对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失,在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时,计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后,对于该类金融负债以公允价值进行后续计量,除与套期会计有关外,产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后,对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

##### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时,本基金终止确认该金融资产:

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

-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;

-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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的,本基金将下列两项金额的差额计入当期损益:

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值;

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的,本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础,对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备:

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失,是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失,是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额,即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时,本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失,是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失,是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月,则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失,是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备,对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备:

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险;或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化,本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失,由此形成的损失准备的增加或转回金额,应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产,损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

## 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 30%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于基金费用的不同，本基金各类基金份额在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市

场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》。

#### (a) 新金融工具准则

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

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

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

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

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

#### (b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》编制财务报表时，调整了部分财务报表项目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

执行上述会计政策对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收清算款、应收利息、应收股利、应收申购款和其他资产，对应的账面价值分别为人民币 3,318,479.10 元、3,343,360.72 元、144,754.67 元、0.00 元、4,341,738.03 元、6,736,207.68 元、0.00 元、254.69 元和 0.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收清算款、应收股利、应收申购款、其他资产和债权投资，对应的账面价值分别为人民币 3,319,100.34 元、3,345,015.67 元、144,826.39 元、0.00 元、4,341,738.03 元、0.00 元、254.69 元、0.00 元和 0.00 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 980,337,501.68 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 987,071,361.45 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 233,034,531.45 元、4,464,515.83 元、0.00 元、392,933.51 元、65,488.94 元、10,168.20 元、356,354.08 元、67,551.40 元和 160,000.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 233,102,082.85 元、4,464,515.83 元、0.00 元、392,933.51 元、65,488.94 元、10,168.20 元和 516,354.08 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科

目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产

生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	3,031,155.42	3,318,479.10
等于：本金	3,030,882.79	3,318,479.10
加：应计利息	272.63	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	3,031,155.42	3,318,479.10

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	160,893,904.20	-	151,117,425.75	-9,776,478.45	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	232,332,414.35	344,538.58	201,941,565.09	-30,735,387.84
	银行间市场	19,945,200.00	304,290.41	20,306,290.41	56,800.00
	合计	252,277,614.35	648,828.99	222,247,855.50	-30,678,587.84
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	413,171,518.55	648,828.99	373,365,281.25	-40,455,066.29	
项目	上年度末				
	2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	308,300,980.71	-	299,884,250.70	-8,416,730.01	

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	354,140,348.98	-	355,549,250.98	1,408,902.00
	银行间市场	319,807,040.82	-	324,904,000.00	5,096,959.18
	合计	673,947,389.80	-	680,453,250.98	6,505,861.18
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		982,248,370.51	-	980,337,501.68	-1,910,868.83

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金于本报告期末未持有任何期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金于本报告期末未持有任何黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-9,685.20	-
银行间市场	-	-
合计	-9,685.20	-
项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金于本报告期末及上年度末均未计提减值准备。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末及上年度末均未计提债权投资减值准备。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末及上年度末均未计提其他债权投资减值准备。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具。

#### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	6,736,207.68
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	6,736,207.68

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 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	-	-
应付交易费用	183,267.15	356,354.08
其中：交易所市场	183,146.65	350,586.52
银行间市场	120.50	5,767.56
应付利息	-	67,551.40
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	36,000.00	40,000.00

合计	339,267.15	583,905.48
----	------------	------------

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 太平睿安混合 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	687,398,511.64	687,398,511.64
本期申购	39,406,918.82	39,406,918.82
本期赎回（以“-”号填列）	-350,987,802.39	-350,987,802.39
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	375,817,628.07	375,817,628.07

##### 太平睿安混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,414,039.11	22,414,039.11
本期申购	22,227,325.72	22,227,325.72
本期赎回（以“-”号填列）	-20,745,697.02	-20,745,697.02
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	23,895,667.81	23,895,667.81

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 太平睿安混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	41,563,679.58	6,844,182.33	48,407,861.91
本期利润	-55,556,264.22	-36,414,648.09	-91,970,912.31
本期基金份额交易产生的变动数	-7,487,296.29	31,983,311.55	24,496,015.26
其中：基金申购款	2,410,280.62	-597,015.23	1,813,265.39
基金赎回款	-9,897,576.91	32,580,326.78	22,682,749.87
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-21,479,880.93	2,412,845.79	-19,067,035.14
-----	----------------	--------------	----------------

## 太平睿安混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,213,301.58	222,906.66	1,436,208.24
本期利润	-1,883,031.88	-2,129,549.37	-4,012,581.25
本期基金份额交易产生的变动数	-937,449.68	2,056,682.67	1,119,232.99
其中：基金申购款	-540,336.75	718,123.06	177,786.31
基金赎回款	-397,112.93	1,338,559.61	941,446.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,607,179.98	150,039.96	-1,457,140.02

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	27,326.84	23,881.53
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	26,540.73	55,315.54
其他	2,115.58	1,650.57
合计	55,983.15	80,847.64

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-56,220,161.48	38,482,159.85
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-56,220,161.48	38,482,159.85

## 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	526,997,701.86	619,097,299.57
减：卖出股票成本总额	581,844,515.80	580,615,139.72
减：交易费用	1,373,347.54	-
买卖股票差价收入	-56,220,161.48	38,482,159.85

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	4,773,829.11	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,593,365.28	13,975,350.46
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,180,463.83	13,975,350.46

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,108,401,499.49	527,019,074.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,102,190,613.96	507,362,619.47
减：应计利息总额	8,770,003.79	5,681,104.59
减：交易费用	34,247.02	-
买卖债券差价收入	-2,593,365.28	13,975,350.46

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益—赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益—申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益—买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益—赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益—申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益—其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,543,557.77	2,854,888.46
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,543,557.77	2,854,888.46

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-38,544,197.46	-9,740,064.64
股票投资	-1,359,748.44	-15,068,401.36
债券投资	-37,184,449.02	5,328,336.72
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	-38,544,197.46	-9,740,064.64

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	93,930.80	65,442.63
基金转换费收入	-	14.93
合计	93,930.80	65,457.56

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	36,000.00	31,769.96
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	6,173.55	9,862.69
账户维护费	36,000.00	29,400.00
开户费	-	400.00
交易费用	-	1,851,099.72
其他	1,200.00	-
合计	199,373.55	2,042,532.37

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,107,218.56	4,054,026.76
其中：支付销售机构的客户维护费	43,856.62	126,193.48

注：支付基金管理人太平基金管理有限公司的基金管理费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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日的基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	517,869.78	675,671.20

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C	合计
太平基金管理有限公司	-	62,697.60	62,697.60
兴业银行股份有限公司	-	17,863.97	17,863.97
合计	-	80,561.57	80,561.57
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C	合计
太平基金管理有限公司	-	104,828.81	104,828.81
兴业银行股份有限公司	-	54,150.66	54,150.66
合计	-	158,979.47	158,979.47

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比区间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

本基金在本报告期内及上年度可比区间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金在本报告期内及上年度可比区间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

基金管理人于本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

太平睿安混合 A

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
太平人寿保 险有限公司	344,306,178.95	91.6152	-	-

##### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	3,031,155.42	27,326.84	3,318,479.10	23,881.53

注：本基金通过“兴业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2022 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 538,212.29 元。（2021 年 12 月 31 日：人民币 3,343,360.72 元）

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	锁定期股票	58.00	86.49	339	19,662.00	29,320.11	-
301121	紫建电子	2022 年 8 月 1 日	6 个月	锁定期股票	61.07	49.77	280	17,099.60	13,935.60	-
301132	满坤科技	2022 年 8 月 3 日	6 个月	锁定期股票	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	锁定期股票	38.46	25.31	441	16,960.86	11,161.71	-
301152	天力锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月	锁定期股票	57.00	46.64	294	16,758.00	13,712.16	-
301161	唯万密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	锁定期股票	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301171	易点天下	2022 年 8 月 10 日	6 个月	锁定期股票	18.18	17.72	614	11,162.52	10,880.08	-

301176	逸豪新材	2022年 9月21 日	6个月	锁定期 股票	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301195	北路智控	2022年 7月25 日	6个月	锁定期 股票	71.17	73.04	230	16,369.10	16,799.20	-
301197	工大科雅	2022年 7月29 日	6个月	锁定期 股票	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301227	森鹰窗业	2022年 9月16 日	6个月	锁定期 股票	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301231	荣信文化	2022年 8月31 日	6个月	锁定期 股票	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24 日	6个月	锁定期 股票	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22 日	6个月	锁定期 股票	33.65	69.68	503	16,925.95	35,049.04	-
301265	华新环保	2022年 12月8 日	6个月	锁定期 股票	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年 10月26 日	6个月	锁定期 股票	50.88	66.20	269	13,686.72	17,807.80	-
301269	华大九天	2022年 7月21 日	6个月	锁定期 股票	32.69	87.94	349	11,408.81	30,691.06	-
301276	嘉曼服饰	2022年 9月1 日	6个月	锁定期 股票	40.66	22.61	299	12,157.34	6,760.39	-
301277	新天地	2022年 11月9 日	6个月	锁定期 股票	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301280	珠城科技	2022年 12月19 日	6个月	锁定期 股票	67.40	44.80	245	16,513.00	10,976.00	-
301290	东星医疗	2022年 11月23 日	6个月	锁定期 股票	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301296	新巨丰	2022年 8月26 日	6个月	锁定期 股票	18.19	14.90	937	17,044.03	13,961.30	-

		日									
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	锁定期股票	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07		-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	锁定期股票	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22		-
301308	江波龙	2022年7月27日	6个月	锁定期股票	55.67	56.72	347	19,317.49	19,681.84		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	锁定期股票	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88		-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	锁定期股票	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	锁定期股票	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	锁定期股票	64.68	41.74	202	13,065.36	8,431.48		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	锁定期股票	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-
301326	捷邦科技	2022年9月9日	6个月	锁定期股票	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74		-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	锁定期股票	78.80	76.96	164	12,923.20	12,621.44		-
301330	熵基科技	2022年8月10日	6个月	锁定期股票	43.32	31.31	555	24,042.60	17,377.05		-
301335	天元宠物	2022年11月11日	6个月	锁定期股票	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40		-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	锁定期股票	18.78	15.59	645	12,113.10	10,055.55		-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	锁定期股票	138.88	103.52	95	13,193.60	9,834.40		-
301359	东南	2022年	6个月	锁定期	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20		-

	电子	11月2日		股票							
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	锁定期股票	30.66	37.85	425	13,030.50	16,086.25		-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	锁定期股票	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92		-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	锁定期股票	65.35	45.09	250	16,337.50	11,272.50		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	锁定期股票	119.88	175.78	110	13,186.80	19,335.80		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	锁定期股票	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24		-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	锁定期股票	22.50	17.16	762	17,145.00	13,075.92		-
301396	宏景科技	2022年11月4日	6个月	锁定期股票	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40		-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	锁定期股票	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70		-
688035	德邦科技	2022年9月9日	6个月	锁定期股票	46.12	48.82	3,785	174,564.20	184,783.70		-
688084	晶品特装	2022年12月1日	6个月	锁定期股票	60.98	74.73	1,718	104,763.64	128,386.14		-
688275	万润新能	2022年9月21日	6个月	锁定期股票	299.88	168.85	677	203,018.76	114,311.45		-
688391	钜泉科技	2022年9月5日	6个月	锁定期股票	115.00	95.83	931	107,065.00	89,217.73		-
688400	凌云光	2022年6月27日	6个月	锁定期股票	21.93	25.28	7,233	158,619.69	182,850.24		-
688455	科捷智能	2022年9月7日	6个月	锁定期股票	21.88	13.12	5,277	115,460.76	69,234.24		-

688489	三未信安	2022年11月25日	6个月	锁定期股票	78.89	90.62	1,575	124,251.75	142,726.50	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
110091	合力转债	2022年12月14日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	1,380	138,000.00	138,011.49	-

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

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	21,111,775.34	-
合计	21,111,775.34	-

注：未评级债券为国债以及政策性金融债等无信用评级的债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	30,144,600.39	398,219,689.53
AAA 以下	170,991,479.77	99,700,561.45
未评级	-	182,533,000.00
合计	201,136,080.16	680,453,250.98

注：未评级债券为地方政府债及政策性金融债等无信用评级的债券。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备用金、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。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	3,031,155.42	-	-	-	3,031,155.42
结算备付金	538,212.29	-	-	-	538,212.29
存出保证金	79,251.62	-	-	-	79,251.62
交易性金融资产	222,247,855.50	-	-	-151,117,425.75	373,365,281.25
买入返售金融资产	-9,685.20	-	-	-	-9,685.20
应收清算款	-	-	-	48,037,579.20	48,037,579.20
应收申购款	-	-	-	244.76	244.76
<b>资产总计</b>	<b>225,886,789.63</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-199,155,249.71</b>	<b>425,042,039.34</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	45,247,048.66	45,247,048.66
应付管理人报酬	-	-	-	217,957.73	217,957.73
应付托管费	-	-	-	36,326.26	36,326.26
应付销售服务费	-	-	-	9,989.25	9,989.25
应付税费	-	-	-	2,329.57	2,329.57
其他负债	-	-	-	339,267.15	339,267.15
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>45,852,918.62</b>	<b>45,852,918.62</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>225,886,789.63</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-153,302,331.09</b>	<b>379,189,120.72</b>
<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	3,318,479.10	-	-	-	3,318,479.10
结算备付金	3,343,360.72	-	-	-	3,343,360.72
存出保证金	144,754.67	-	-	-	144,754.67
交易性金融资产	264,357,250.98	375,122,000.00	40,974,000.00	299,884,250.70	980,337,501.68

应收清算款	-	-	-	4,341,738.03	4,341,738.03
应收申购款	-	-	-	254.69	254.69
其他资产	-	-	-	6,736,207.68	6,736,207.68
资产总计	271,163,845.47	375,122,000.00	40,974,000.00	310,962,451.10	998,222,296.57
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	233,034,531.45	-	-	-	233,034,531.45
应付清算款	-	-	-	4,464,515.83	4,464,515.83
应付管理人报酬	-	-	-	392,933.51	392,933.51
应付托管费	-	-	-	65,488.94	65,488.94
应付销售服务费	-	-	-	10,168.20	10,168.20
应交税费	-	-	-	14,132.26	14,132.26
其他负债	-	-	-	583,905.48	583,905.48
负债总计	233,034,531.45	-	-	5,531,144.22	238,565,675.67
利率敏感度缺口	38,129,314.02	375,122,000.00	40,974,000.00	305,431,306.88	759,656,620.90

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金资产负债表日的利率风险状况		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	2,278,906.12	6,799,362.53
	2. 市场利率上升 25 个基点	-2,246,570.75	-6,715,388.74

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-40%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	151,117,425.75	39.85	299,884,250.70	39.48
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	151,117,425.75	39.85	299,884,250.70	39.48

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升	4,689,453.94	11,066,974.58

	5%		
	沪深 300 指数下降	-4,689,453.94	-11,066,974.58
	5%		

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	350,636,954.76	437,964,888.68
第二层次	22,728,326.49	542,372,613.00
第三层次	-	-
合计	373,365,281.25	980,337,501.68

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未持有第三层次公允价值资产。

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

本基金在本报告期末及上年度期末均未持有第三层次公允价值资产。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	151,117,425.75	35.55
	其中：股票	151,117,425.75	35.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	222,247,855.50	52.29
	其中：债券	222,247,855.50	52.29
	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	-9,685.20	-0.00
	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	3,569,367.71	0.84
8	其他各项资产	48,117,075.58	11.32
9	合计	425,042,039.34	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,185,354.00	0.31
B	采矿业	-	-
C	制造业	118,384,829.66	31.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,794,719.81	7.07
J	金融业	82,553.38	0.02
K	房地产业	4,304,957.00	1.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	129,624.36	0.03
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	229,783.04	0.06
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	151,117,425.75	39.85

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300298	三诺生物	748,220	25,237,460.60	6.66
2	600566	济川药业	271,800	7,398,396.00	1.95
3	300760	迈瑞医疗	22,400	7,077,728.00	1.87
4	300454	深信服	58,300	6,561,665.00	1.73
5	600690	海尔智家	262,000	6,408,520.00	1.69
6	300049	福瑞股份	257,000	6,278,510.00	1.66
7	600588	用友网络	252,300	6,098,091.00	1.61
8	688023	安恒信息	27,781	5,500,638.00	1.45
9	002594	比亚迪	19,500	5,010,915.00	1.32
10	601012	隆基绿能	115,100	4,864,126.00	1.28
11	300775	三角防务	116,500	4,427,000.00	1.17
12	300751	迈为股份	10,700	4,406,688.00	1.16
13	688369	致远互联	58,222	4,008,584.70	1.06
14	001979	招商蛇口	261,900	3,307,797.00	0.87
15	688680	海优新材	17,760	3,290,928.00	0.87
16	300274	阳光电源	27,300	3,052,140.00	0.80
17	300604	长川科技	67,300	3,000,234.00	0.79
18	688599	天合光能	46,070	2,937,423.20	0.77
19	600309	万华化学	29,200	2,705,380.00	0.71
20	002511	中顺洁柔	194,100	2,666,934.00	0.70
21	600399	抚顺特钢	184,400	2,638,764.00	0.70
22	603606	东方电缆	38,900	2,638,587.00	0.70

23	002439	启明星辰	97,100	2,532,368.00	0.67
24	688085	三友医疗	90,593	2,513,955.75	0.66
25	300737	科顺股份	194,000	2,440,520.00	0.64
26	000568	泸州老窖	9,800	2,197,944.00	0.58
27	603100	川仪股份	68,000	2,127,720.00	0.56
28	600600	青岛啤酒	19,500	2,096,250.00	0.55
29	300719	安达维尔	145,500	1,645,605.00	0.43
30	688687	凯因科技	67,895	1,544,611.25	0.41
31	300893	松原股份	48,500	1,304,650.00	0.34
32	603806	福斯特	18,000	1,195,920.00	0.32
33	603477	巨星农牧	48,600	1,185,354.00	0.31
34	603737	三棵树	9,800	1,115,534.00	0.29
35	300115	长盈精密	97,100	1,003,043.00	0.26
36	600657	信达地产	194,000	997,160.00	0.26
37	002036	联创电子	77,600	959,912.00	0.25
38	688368	晶丰明源	7,761	866,903.70	0.23
39	301269	华大九天	3,484	313,060.51	0.08
40	301301	川宁生物	34,740	305,847.92	0.08
41	301095	广立微	3,382	300,238.40	0.08
42	301367	怡和嘉业	1,093	235,173.11	0.06
43	301308	江波龙	3,461	203,345.56	0.05
44	301267	华夏眼科	2,689	194,734.00	0.05
45	688035	德邦科技	3,785	184,783.70	0.05
46	688400	凌云光	7,233	182,850.24	0.05
47	301363	美好医疗	4,245	176,182.45	0.05
48	301335	天元宠物	4,192	147,884.08	0.04
49	301121	紫建电子	2,799	143,790.05	0.04
50	688489	三未信安	1,575	142,726.50	0.04
51	301311	昆船智能	8,120	142,411.76	0.04
52	301152	天力锂能	2,932	140,863.76	0.04
53	301396	宏景科技	3,960	134,592.48	0.04
54	301365	矩阵股份	5,160	129,624.36	0.03
55	688084	晶品特装	1,718	128,386.14	0.03
56	301277	新天地	4,384	125,209.57	0.03
57	301290	东星医疗	3,291	122,423.13	0.03
58	301132	满坤科技	4,672	118,322.32	0.03
59	301366	一博科技	2,497	116,656.80	0.03
60	301280	珠城科技	2,449	116,217.00	0.03
61	688275	万润新能	677	114,311.45	0.03
62	301171	易点天下	6,037	112,344.41	0.03
63	688496	C 清越	11,640	105,691.20	0.03
64	301339	通行宝	6,345	104,504.55	0.03
65	301349	信德新材	948	104,056.78	0.03

66	301265	华新环保	7,981	96,784.62	0.03
67	301176	逸豪新材	5,331	92,912.79	0.02
68	688391	钜泉科技	931	89,217.73	0.02
69	301326	捷邦科技	2,264	87,002.05	0.02
70	301227	森鹰窗业	2,840	86,972.16	0.02
71	301318	维海德	2,016	85,526.48	0.02
72	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.02
73	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.02
74	301197	工大科雅	3,791	77,521.79	0.02
75	301359	东南电子	3,271	71,332.06	0.02
76	301276	嘉曼服饰	2,988	69,387.20	0.02
77	688455	科捷智能	5,277	69,234.24	0.02
78	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
79	301316	慧博云通	3,584	67,028.63	0.02
80	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.02
81	301319	唯特偶	1,149	66,253.15	0.02
82	301300	远翔新材	2,107	63,702.75	0.02
83	301309	万得凯	2,271	56,692.74	0.01
84	301239	普瑞眼科	503	35,049.04	0.01
85	301330	熵基科技	555	17,377.05	0.00
86	301195	北路智控	230	16,799.20	0.00
87	301296	新巨丰	937	13,961.30	0.00
88	301389	隆扬电子	762	13,075.92	0.00
89	301328	维峰电子	164	12,621.44	0.00
90	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.00
91	301139	元道通信	441	11,161.71	0.00
92	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
93	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
94	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600566	济川药业	14,375,478.00	1.89
2	300298	三诺生物	12,976,989.66	1.71
3	688680	海优新材	12,640,418.30	1.66
4	002603	以岭药业	12,584,660.00	1.66
5	300454	深信服	10,540,303.75	1.39
6	300049	福瑞股份	10,390,058.00	1.37
7	300776	帝尔激光	9,977,801.00	1.31
8	688369	致远互联	9,875,763.60	1.30
9	002837	英维克	9,166,749.72	1.21

10	300760	迈瑞医疗	8,518,386.78	1.12
11	000661	长春高新	8,511,978.00	1.12
12	688017	绿的谐波	8,141,175.60	1.07
13	603305	旭升集团	7,562,598.28	1.00
14	001979	招商蛇口	6,934,659.00	0.91
15	000002	万科 A	6,845,512.00	0.90
16	601689	拓普集团	6,816,952.00	0.90
17	600588	用友网络	6,687,233.00	0.88
18	300130	新国都	6,499,520.00	0.86
19	300674	宇信科技	6,356,843.80	0.84
20	300751	迈为股份	6,130,595.00	0.81

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002603	以岭药业	15,180,054.87	2.00
2	601689	拓普集团	15,038,367.00	1.98
3	300760	迈瑞医疗	13,765,907.00	1.81
4	300298	三诺生物	12,842,334.00	1.69
5	600566	济川药业	11,934,407.36	1.57
6	603806	福斯特	11,457,596.17	1.51
7	603596	伯特利	10,760,712.00	1.42
8	300776	帝尔激光	10,576,612.40	1.39
9	603305	旭升集团	9,442,225.24	1.24
10	000661	长春高新	8,583,362.00	1.13
11	000333	美的集团	8,325,821.00	1.10
12	300073	当升科技	8,133,175.30	1.07
13	688680	海优新材	7,801,646.89	1.03
14	600329	达仁堂	7,416,381.00	0.98
15	002837	英维克	7,340,878.56	0.97
16	002371	北方华创	7,032,915.00	0.93
17	688017	绿的谐波	6,792,702.85	0.89
18	601688	华泰证券	6,728,110.00	0.89
19	000002	万科 A	6,510,725.00	0.86
20	688369	致远互联	6,478,082.57	0.85

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	434,437,439.29
卖出股票收入(成交)总额	526,997,701.86

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，

不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	805,484.93	0.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,306,290.41	5.36
	其中：政策性金融债	20,306,290.41	5.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	201,136,080.16	53.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	222,247,855.50	58.61

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	220401	22 农发 01	200,000	20,306,290.41	5.36
2	113621	彤程转债	58,210	7,524,376.11	1.98
3	127038	国微转债	48,280	7,507,526.77	1.98
4	113582	火炬转债	39,420	7,276,143.60	1.92
5	123107	温氏转债	50,450	6,287,313.97	1.66

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	79,251.62
2	应收清算款	48,037,579.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	244.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,117,075.58

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113621	彤程转债	7,524,376.11	1.98
2	127038	国微转债	7,507,526.77	1.98
3	113582	火炬转债	7,276,143.60	1.92
4	123107	温氏转债	6,287,313.97	1.66
5	123067	斯莱转债	6,124,166.12	1.62
6	123108	乐普转 2	6,121,650.55	1.61
7	113602	景 20 转债	5,912,646.55	1.56
8	113049	长汽转债	5,567,479.41	1.47
9	123114	三角转债	5,410,836.58	1.43
10	113060	浙 22 转债	5,274,045.46	1.39
11	127030	盛虹转债	5,250,369.72	1.38
12	127049	希望转 2	4,861,894.76	1.28
13	113025	明泰转债	4,503,684.56	1.19
14	111000	起帆转债	4,134,186.26	1.09
15	113622	杭叉转债	4,123,996.85	1.09
16	113632	鹤 21 转债	4,118,377.40	1.09
17	127031	洋丰转债	3,894,779.35	1.03
18	118003	华兴转债	3,823,510.03	1.01
19	127043	川恒转债	3,794,897.95	1.00
20	123120	隆华转债	3,716,040.77	0.98
21	127036	三花转债	3,654,308.64	0.96
22	123025	精测转债	3,472,517.74	0.92
23	127018	本钢转债	3,389,611.85	0.89
24	113045	环旭转债	3,322,988.65	0.88
25	123149	通裕转债	3,291,978.89	0.87
26	113623	凤 21 转债	3,191,145.87	0.84
27	127058	科伦转债	3,087,715.62	0.81
28	110084	贵燃转债	3,058,468.14	0.81
29	118005	天奈转债	2,476,546.71	0.65
30	113636	甬金转债	2,247,888.05	0.59
31	127055	精装转债	2,246,432.04	0.59
32	127012	招路转债	2,237,978.53	0.59
33	110087	天业转债	2,124,699.43	0.56
34	127061	美锦转债	2,066,938.46	0.55
35	128137	洁美转债	1,859,415.72	0.49
36	127062	垒知转债	1,767,938.48	0.47
37	123121	帝尔转债	1,659,998.30	0.44
38	128017	金禾转债	1,645,948.48	0.43
39	127020	中金转债	1,642,286.49	0.43
40	123085	万顺转 2	1,630,834.16	0.43
41	110061	川投转债	1,389,256.96	0.37
42	123077	汉得转债	1,342,907.32	0.35

43	123105	拓尔转债	1,320,987.40	0.35
44	127045	牧原转债	1,172,006.58	0.31
45	123035	利德转债	1,159,221.02	0.31
46	128106	华统转债	1,150,906.40	0.30
47	128083	新北转债	1,146,529.92	0.30
48	113648	巨星转债	1,062,062.88	0.28
49	127033	中装转 2	985,232.09	0.26
50	123083	朗新转债	492,480.61	0.13

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
太平睿安混合 A	139	2,703,723.94	374,306,821.95	99.5980	1,510,806.12	0.4020
太平睿安混合 C	94	254,209.23	19,870,839.54	83.1567	4,024,828.27	16.8433
合计	226	1,768,642.90	394,177,661.49	98.6151	5,535,634.39	1.3849

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	太平睿安混合 A	104,064.29	0.0277
	太平睿安混合 C	11,020.56	0.0461
	合计	115,084.85	0.0288

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金	太平睿安混合 A	0~10

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	太平睿安混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	太平睿安混合 A	0
	太平睿安混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C
基金合同生效日 (2020 年 11 月 10 日) 基金份额总额	269,428,868.24	77,587,595.31
本报告期期初基金份额总额	687,398,511.64	22,414,039.11
本报告期基金总申购份额	39,406,918.82	22,227,325.72
减：本报告期基金总赎回份额	350,987,802.39	20,745,697.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	375,817,628.07	23,895,667.81

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动情况

(1) 本基金管理人于 2022 年 1 月 21 日发布公告，自 2022 年 1 月 19 日起季勇先生不再担任公司助理总经理职务。

(2) 本基金管理人于 2022 年 6 月 11 日发布公告，自 2022 年 6 月 10 日起董晓亮先生担任公司副总经理。

(3) 本基金管理人于 2022 年 7 月 29 日发布公告，自 2022 年 7 月 27 日起邓先虎先生担任公司副总经理。

(4) 本基金管理人于 2022 年 11 月 26 日发布公告, 自 2022 年 11 月 25 日起范宇先生担任公司首席信息官, 王炯女士不再兼任公司首席信息官职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务, 报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为人民币叁万陆仟元整, 其已提供审计服务的连续年限为 2 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 本公司及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内, 本托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
民生证券	2	93,244,232.87	10.11	67,565.16	9.77	-
东吴证券	1	78,197,492.01	8.48	57,186.09	8.27	-
信达证券	2	75,149,559.70	8.15	54,957.43	7.95	-
浙商证券	1	74,269,159.10	8.05	52,943.91	7.66	-
招商证券	1	70,190,828.61	7.61	65,368.56	9.45	-

海通证券	1	69,692,160.59	7.55	50,964.98	7.37	-
天风证券	1	66,086,357.94	7.16	47,120.47	6.82	-
中银国际证券	1	43,884,195.72	4.76	31,535.16	4.56	-
东北证券	1	41,550,445.49	4.50	30,385.84	4.40	-
华西证券	1	40,580,001.95	4.40	29,676.46	4.29	-
兴业证券	1	38,940,639.76	4.22	36,265.09	5.25	-
国海证券	1	32,673,624.04	3.54	23,894.67	3.46	-
华创证券	2	30,206,204.86	3.27	22,041.33	3.19	-
西藏东方财富证券	1	29,383,834.90	3.18	21,487.80	3.11	-
湘财证券	1	28,731,429.72	3.11	20,723.90	3.00	-
长江证券	2	25,663,342.77	2.78	18,525.98	2.68	-
中泰证券	1	20,349,882.72	2.21	14,882.00	2.15	-
中信建投证券	2	18,186,168.77	1.97	12,937.20	1.87	-
东方证券	2	16,685,269.23	1.81	11,868.07	1.72	-
安信证券	1	11,253,389.71	1.22	8,229.72	1.19	-
光大证券	1	10,040,428.56	1.09	7,342.52	1.06	-
申万宏源证券	2	7,684,026.78	0.83	5,465.72	0.79	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

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

本期新增民生证券 2 个交易单元、信达证券 2 个交易单元、浙商证券 1 个交易单元、西藏东方财富证券 1 个交易单元、湘财证券 1 个交易单元、安信证券 1 个交易单元。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
民生证券	121,469,198.26	8.55	236,000,000.00	14.74	-	-
东吴证券	66,045,577.62	4.65	435,000,000.00	27.16	-	-
信达证券	38,525,837.85	2.71	-	-	-	-
浙商证券	50,057,064.56	3.52	-	-	-	-
招商证券	144,120,833.90	10.15	37,000,000.00	2.31	-	-
海通证券	68,720,957.48	4.84	-	-	-	-
天风证券	40,933,484.11	2.88	-	-	-	-
中银国际证券	100,436,232.11	7.07	-	-	-	-
东北证券	124,410,794.69	8.76	224,500,000.00	14.02	-	-
华西证券	36,511,448.46	2.57	41,000,000.00	2.56	-	-
兴业证券	59,642,147.34	4.20	-	-	-	-
国海证券	71,808,322.29	5.06	309,000,000.00	19.30	-	-

华创证 券	130,667,470 .88	9.20	32,900,000.0 0	2.05	-	-
西藏东 方财富 证券	11,793,837. 50	0.83	286,000,000. 00	17.86	-	-
湘财证 券	41,149,218. 22	2.90	-	-	-	-
长江证 券	30,807,802. 93	2.17	-	-	-	-
中泰证 券	24,049,000. 00	1.69	-	-	-	-
中信建 投证券	61,114,037. 10	4.30	-	-	-	-
东方证 券	2,933,270.0 0	0.21	-	-	-	-
安信证 券	16,359,907. 96	1.15	-	-	-	-
光大证 券	17,765,842. 61	1.25	-	-	-	-
申万宏 源证券	9,505,281.2 9	0.67	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
中原证 券	151,472,000 .00	10.66	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于太平睿安混合型证券投资基金调整大额申购、转换转入及定期定额投资业务限额的公告	中国证监会规定媒介	2022年1月14日
2	太平基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2022年1月21日
3	太平睿安混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2022年1月24日
4	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022年3月15日
5	太平睿安混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会规定媒介	2022年3月30日
6	太平睿安混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022年4月20日
7	太平睿安混合型证券投资基金招募说	中国证监会规定媒介	2022年4月20日

	说明书（更新）		
8	太平睿安混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2022年4月20日
9	太平睿安混合型证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2022年4月22日
10	太平睿安混合型证券投资基金2022年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2022年7月21日
11	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022年8月15日
12	太平睿安混合型证券投资基金2022年中期报告	中国证监会规定媒介	2022年8月31日
13	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加玄元保险代理有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022年10月17日
14	太平睿安混合型证券投资基金2022年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2022年10月26日
15	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加和耕传承基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022年11月30日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20221231	344,306,178.95	-	-	344,306,178.95	86.1383
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

注：报告期初、期末同一投资者通过多个基金账户持有本基金的合并计算。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平睿安混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平睿安混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平睿安混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：[www.taipingfund.com.cn](http://www.taipingfund.com.cn)

太平基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日