

太平睿盈混合型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 19 日

§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责任。

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 2024 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	太平睿盈混合
基金主代码	006973
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 日
报告期末基金份额总额	322,797,753.28 份
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</p>

	<p>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。	
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	
下属分级基金的基金简称	太平睿盈混合 A	太平睿盈混合 C
下属分级基金的交易代码	006973	007669
报告期末下属分级基金的份额总额	258,827,885.09 份	63,969,868.19 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	太平睿盈混合 A	太平睿盈混合 C
1. 本期已实现收益	171,353.88	-33,017.68
2. 本期利润	-3,120,120.08	-786,474.71
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0120	-0.0124
4. 期末基金资产净值	249,371,057.25	60,026,109.41
5. 期末基金份额净值	0.9635	0.9383

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、所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、自 2019 年 8 月 13 日起对本基金增加 C 类基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

太平睿盈混合 A

阶段	净值增长率①	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	-1.23%	0.69%	0.44%	0.14%	-1.67%	0.55%
过去六个月	-3.24%	0.74%	2.19%	0.17%	-5.43%	0.57%
过去一年	-6.85%	0.61%	0.64%	0.17%	-7.49%	0.44%

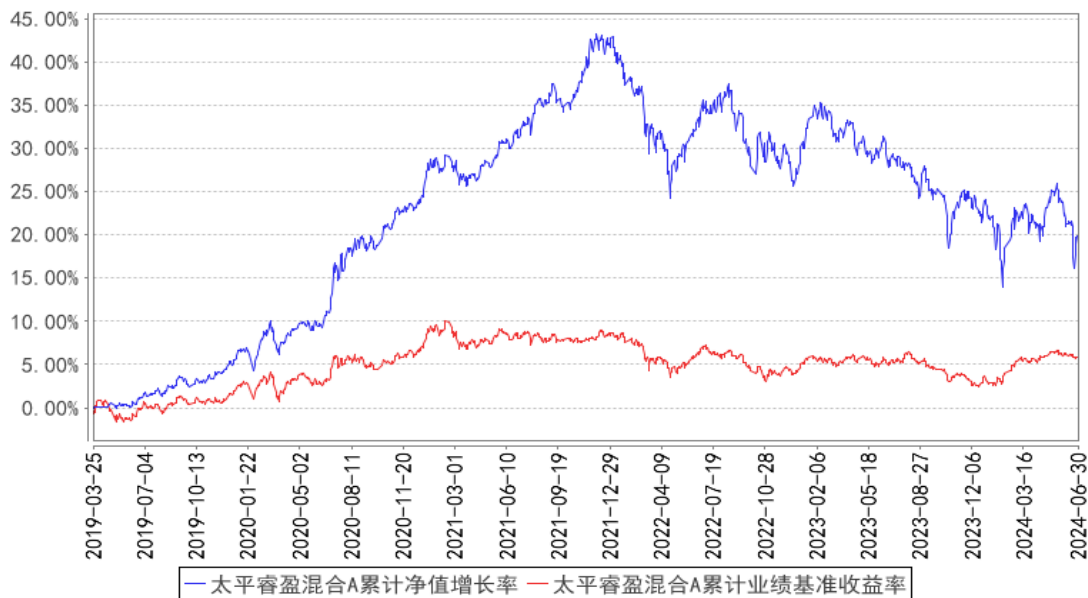
过去三年	-9.17%	0.55%	-2.45%	0.21%	-6.72%	0.34%
过去五年	18.45%	0.48%	5.90%	0.22%	12.55%	0.26%
自基金合同生效起至今	19.91%	0.46%	5.88%	0.23%	14.03%	0.23%

太平睿盈混合 C

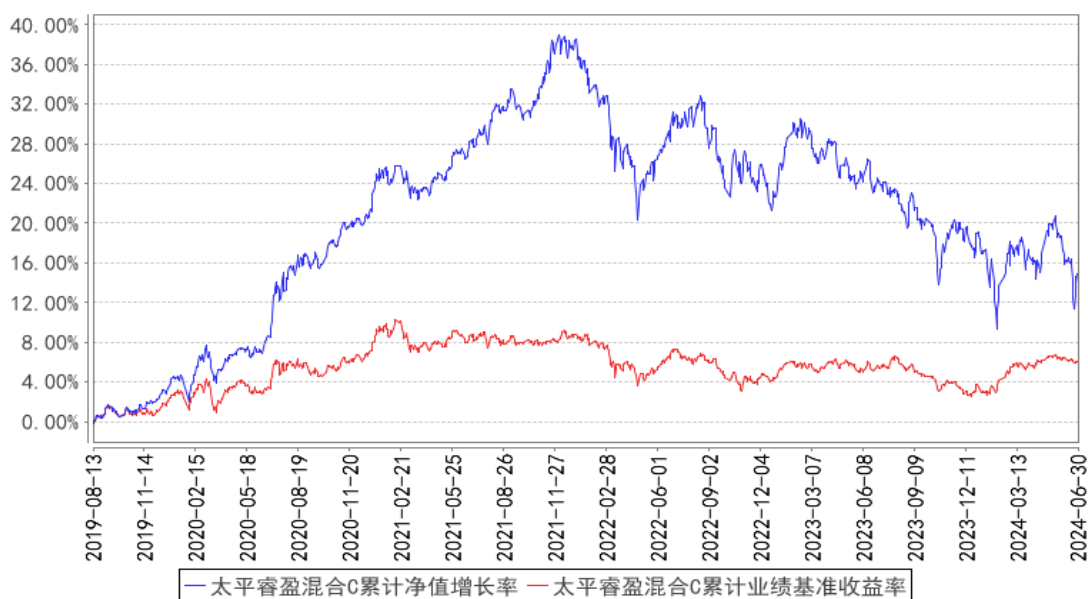
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.37%	0.69%	0.44%	0.14%	-1.81%	0.55%
过去六个月	-3.49%	0.74%	2.19%	0.17%	-5.68%	0.57%
过去一年	-7.33%	0.61%	0.64%	0.17%	-7.97%	0.44%
过去三年	-10.54%	0.55%	-2.45%	0.21%	-8.09%	0.34%
自基金合同生效起至今	14.83%	0.48%	6.03%	0.22%	8.80%	0.26%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

太平睿盈混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



太平睿盈混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 注：1. 本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 25 日，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。
2. 本基金自 2019 年 8 月 13 日起增加 C 类基金份额。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈晓	公司助理 总经理、 固定收益 投资部总 监、本基 金的基金 经理	2019年3月29日	-	14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。2018年11月加入太平基金管理有限公司，现任公司助理总经理、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日至2024年6月24日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型证券投资基金基金经理。
吴超	固定收益 投资部助 理总监、 本基金的 基金经理	2019 年 3 月 25 日	-	11 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，现任固定收益投资部助理总监。2018 年 2 月 12 日至 2022 年 8 月 15 日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 日起任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。2019 年 6 月 27 日起任太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 5 月 28 日起任太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。2020 年 8 月 7 日起任太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2020 年 11 月 12 日起任太平恒久纯债债券型证券投资基金基金经理。2021 年 6 月 24 日起任太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2021 年 9 月 17 日起任太平睿享混合型证券投资基金基金经理。

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；

3、基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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，不存在违法违规或未履行基金合同的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及有关法规，建立公司

内部的公平交易管理制度体系，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，以确保公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，防范不公平交易和利益输送行为。

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，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年二季度我国经济数据延续复苏趋势，高质量发展扎实推进。一季度经济开门红，二季度略有放缓。上半年工业增加值表现较好，高于过去三年均值，但价格指数仍在收缩。

股票市场二季度先扬后抑，新国九条出炉后市场情绪明显好转，上证指数创出年内新高，但市场在 5 月中旬开始回落，市场预期再度偏弱。风格上依然以红利价值较为强势，其他成长风格轮动较多。

债券市场二季度表现继续强劲，长端收益率下行明显，虽然期间债市出现回调，但市场做多情绪仍然较强，30 年国债收益率接近年内低点。可转债市场 6 月波动较大，低价转债价格出现下行，市场担心退市风险和信用风险对转债正股形成负反馈，致使低价转债价格进一步受到影响。我们判断转债大面积价格调整已经接近尾声，同时部分转债价格明显超跌，在缺乏高收益资产大环境下或将迎来修复。本报告期内，本基金保持相对较高的权益仓位，保持均衡配置经济复苏价值板块+军工+科技行业为主，6 月末加仓部分转债并相应调整结构；纯债方面继续以中短久期信用债套息策略为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平睿盈 A 的份额净值增长率为-1.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%；太平睿盈 C 的份额净值增长率为-1.37%，同期业绩比较基准收益率为 0.44%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	80,667,399.20	23.00
	其中：股票	80,667,399.20	23.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	259,642,786.07	74.04
	其中：债券	259,642,786.07	74.04
	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	6,086,701.51	1.74
8	其他资产	4,258,953.99	1.21
9	合计	350,655,840.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
C	制造业	68,515,840.58	22.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,900,800.00	0.61
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	604,560.00	0.20
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	5,868.30	0.00
J	金融业	7,687,680.00	2.48
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,944,000.00	0.63
N	水利、环境和公共设施管理业	8,650.32	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	80,667,399.20	26.07
----	---------------	-------

5.2.2 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股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601233	桐昆股份	849,580	13,559,296.80	4.38
2	601336	新华保险	256,000	7,687,680.00	2.48
3	000519	中兵红箭	472,500	6,931,575.00	2.24
4	300775	三角防务	210,000	6,426,000.00	2.08
5	600685	中船防务	224,600	6,266,340.00	2.03
6	605305	中际联合	224,680	5,794,497.20	1.87
7	002236	大华股份	350,000	5,411,000.00	1.75
8	000738	航发控制	141,100	2,831,877.00	0.92
9	000768	中航西飞	110,000	2,643,300.00	0.85
10	603308	应流股份	198,000	2,459,160.00	0.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	63,415,181.51	20.50
	其中：政策性金融债	20,473,349.73	6.62
4	企业债券	20,527,185.75	6.63
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	175,695,128.73	56.79
8	同业存单	-	-
9	其他	5,290.08	0.00
10	合计	259,642,786.07	83.92

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	149564	21 广发 07	200,000	22,382,842.74	7.23
2	110047	山鹰转债	226,270	21,445,808.61	6.93
3	137982	22 义乌 03	200,000	20,527,185.75	6.63
4	200203	20 国开 03	200,000	20,473,349.73	6.62
5	113033	利群转债	119,040	12,101,488.99	3.91

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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，广发证券股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	85,182.75
2	应收证券清算款	3,965,202.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	208,568.94
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,258,953.99

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110047	山鹰转债	21,445,808.61	6.93
2	113033	利群转债	12,101,488.99	3.91
3	123120	隆华转债	8,138,964.58	2.63
4	110086	精工转债	7,923,961.45	2.56
5	110063	鹰 19 转债	7,301,404.11	2.36
6	123146	中环转 2	6,851,128.23	2.21
7	118028	会通转债	6,703,348.79	2.17
8	113058	友发转债	6,672,339.13	2.16
9	110062	烽火转债	6,633,012.65	2.14
10	113530	大丰转债	6,622,273.97	2.14
11	127071	天箭转债	6,377,428.38	2.06
12	128049	华源转债	6,130,865.07	1.98
13	113048	晶科转债	5,670,410.96	1.83

14	113050	南银转债	5,643,543.70	1.82
15	113641	华友转债	5,592,861.80	1.81
16	127032	苏行转债	5,493,724.51	1.78
17	123174	精锻转债	4,917,006.14	1.59
18	127045	牧原转债	4,150,156.39	1.34
19	127034	绿茵转债	4,086,574.99	1.32
20	113640	苏利转债	3,098,622.76	1.00
21	128105	长集转债	2,875,808.66	0.93
22	113054	绿动转债	2,587,018.26	0.84
23	127101	豪鹏转债	2,572,465.17	0.83
24	110084	贵燃转债	2,326,553.42	0.75
25	127016	鲁泰转债	2,261,751.32	0.73
26	128144	利民转债	1,967,147.95	0.64
27	118031	天 23 转债	1,857,024.66	0.60
28	127068	顺博转债	1,681,395.28	0.54
29	128138	侨银转债	1,459,498.34	0.47
30	127042	嘉美转债	1,368,764.19	0.44
31	123119	康泰转 2	1,276,377.93	0.41
32	113532	海环转债	1,113,845.21	0.36
33	113056	重银转债	924,072.20	0.30
34	128087	孚日转债	895,448.67	0.29
35	128130	景兴转债	871,342.77	0.28
36	111000	起帆转债	827,171.51	0.27
37	127030	盛虹转债	725,361.89	0.23
38	113527	维格转债	582,278.77	0.19
39	127040	国泰转债	567,510.55	0.18
40	128109	楚江转债	554,132.60	0.18
41	110093	神马转债	546,993.85	0.18
42	113665	汇通转债	506,741.92	0.16
43	113545	金能转债	485,890.89	0.16
44	110087	天业转债	205,396.46	0.07
45	118005	天奈转债	28,968.02	0.01

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	太平睿盈混合 A	太平睿盈混合 C
报告期期初基金份额总额	259,865,293.67	63,664,305.86
报告期期间基金总申购份额	75,240.98	1,174,822.18
减:报告期期间基金总赎回份额	1,112,649.56	869,259.85
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	258,827,885.09	63,969,868.19

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20240401 - 20240630	244,316,912.51	-	-	244,316,912.51	75.6873

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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，503A）

9.3 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、400-028-8699

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2024 年 7 月 19 日