

太平睿安混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 20 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 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	55

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	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 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	649,089,809.90 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	619,680,827.28 份	29,408,982.62 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	龚小武
	联系电话	021-38556613	021-52629999-212056
	电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn	gongxiaowu@cib.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	福州市湖东路 154 号
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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		200120	200120
法定代表人		范宇	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》
----------------	---------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.taiping.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	太平基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C
本期已实现收益	29,800,347.15	1,823,183.08
本期利润	21,777,824.74	1,532,498.72
加权平均基金份额本期利润	0.0393	0.0417
本期加权平均净值利润率	3.76%	4.00%
本期基金份额净值增长率	4.27%	4.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C
期末可供分配利润	37,168,402.05	1,664,316.83
期末可供分配基金份额利润	0.0600	0.0566
期末基金资产净值	665,804,378.69	31,497,978.39
期末基金份额净值	1.0744	1.0710
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C
基金份额累计净	7.44%	7.10%

值增长率		
------	--	--

注：1、本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 10 日，截至本报告期末基金成立未满一年。

2、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。

3、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）。

4、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
过去一个月	1.37%	0.30%	-0.43%	0.17%	1.80%	0.13%
过去三个月	4.17%	0.26%	1.09%	0.20%	3.08%	0.06%
过去六个月	4.27%	0.36%	0.73%	0.27%	3.54%	0.09%
自基金合同生效起至今	7.44%	0.36%	2.04%	0.25%	5.40%	0.11%

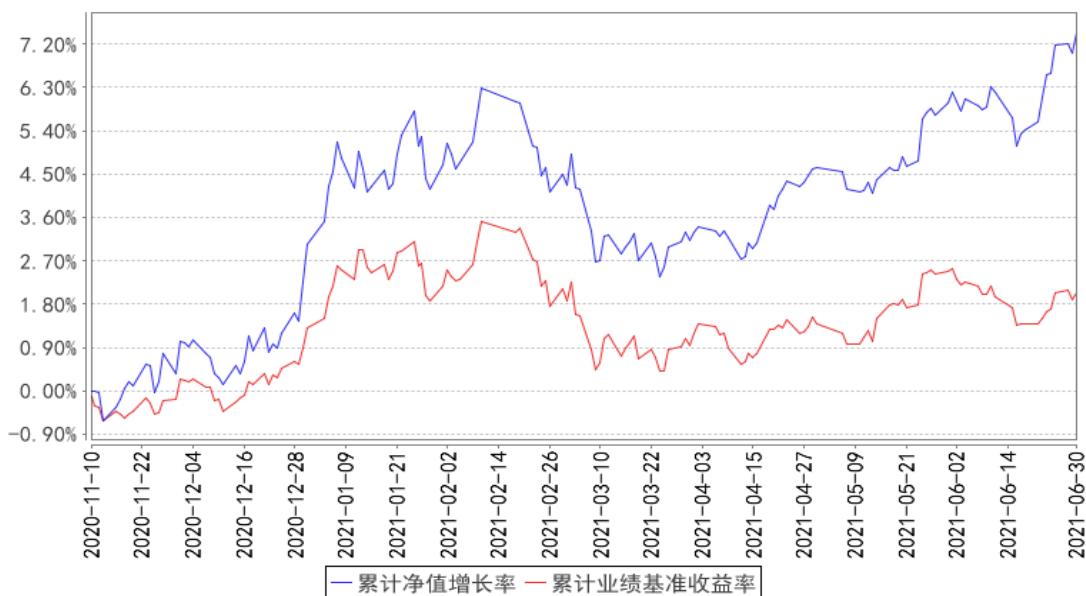
太平睿安混合 C

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
过去一个月	1.32%	0.30%	-0.43%	0.17%	1.75%	0.13%
过去三个月	4.03%	0.26%	1.09%	0.20%	2.94%	0.06%
过去六个月	4.01%	0.36%	0.73%	0.27%	3.28%	0.09%

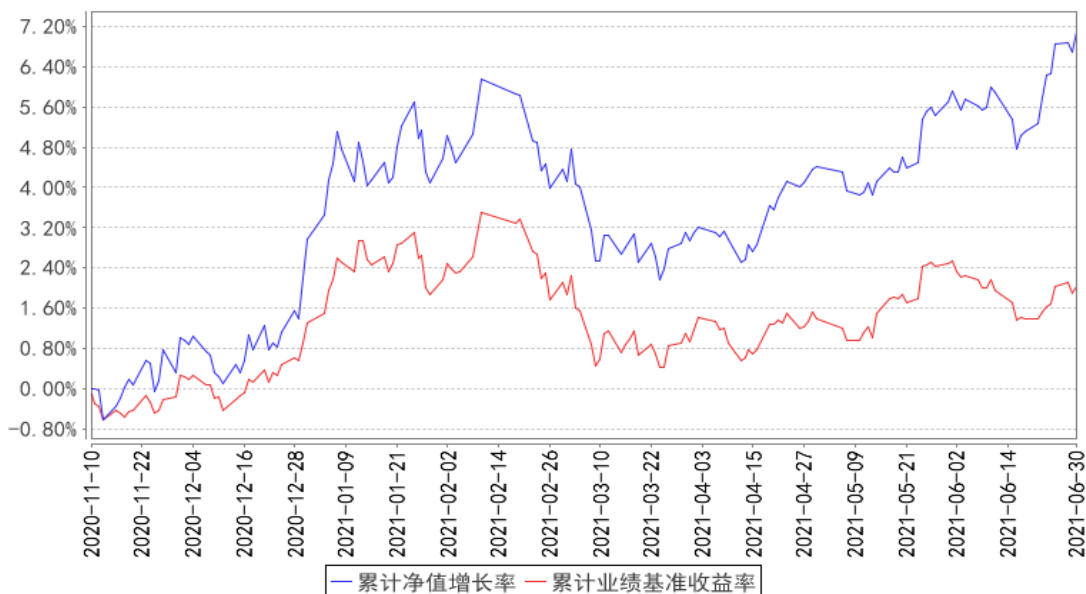
自基金合同生效起 至今	7.10%	0.36%	2.04%	0.25%	5.06%	0.11%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金的建仓期为六个月，截至报告期末本基金已完成建仓，各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立。目前公司注册资本为人民币 4 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 91.5%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 8.5%。

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 19 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金、太平改革红利精选灵活配置混合型证券投资基金、太平恒利纯债债券型证券投资基金、太平睿盈混合型证券投资基金、太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金、太平恒安三个月定期开放债券型证券投资基金、太平恒睿纯债债券型证券投资基金、太平中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、太平恒泽 63 个月定期开放债券型证券投资基金、太平智选一年定期开放股票型发起式证券投资基金、太平行业优选股票型证券投资基金、太平丰和一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平睿安混合型证券投资基金、太平恒久纯债债券型证券投资基金、太平价值增长股票型证券投资基金、太平丰盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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	2020 年 11 月 10 日	-	10 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

	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				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。
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	-	4 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、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；

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

2021 年国内经济延续去年的复苏势头，在去年低基数基础上各项经济数据同比都有明显增长。经济高频数据在二季度略有回落，但整体宏观环境仍然稳中向好。

2021 年上半年债券市场整体呈现出 V 型走势。一季度表现较弱，主要由于一季度经济基本面较好，市场预期政策收紧概率上升，同时通胀压力是制约债券市场的重要因素。二季度债券板块整体表现较好，从 3 月开始至 5 月下旬债券持续了接近一个季度的慢牛行情，最大的支撑因素来自于货币政策未如预期般收紧。5 月开始由于国内定价的黑色系大宗商品出现暴涨，对债市造成一定冲击。但很快商品价格在政策打压下出现大幅调整，债市受到的压力大大缓解。6 月后在美债利率下行、央行加码 300 亿 OMO 投放等利好之下，市场情绪明显转暖。

权益市场方面，2021 上半年出现较大的振幅，同时风格方面也出现较大的切换。1 月初市场大幅上涨，尤其“茅指数”“核心资产”“顺周期”类概念板块出现较大涨幅。随后市场在春节后出现较大调整，一方面前期抱团资产涨幅过大，市场开始担忧业绩增长无法弥补估值大幅上行带来的回调风险，抱团资产出现瓦解，尤其前期估值抬升较高的品种下跌较多，而低估值蓝筹品种则在调整过程中表现相对较好。从 3 月底开始权益市场内部结构分化异常明显：电力设备及新能源、汽车、半导体、医药医疗等板块涨幅明显，而金融、周期和消费类表现相对较弱。

转债市场方面，年初以来低价和平衡性转债溢价水平得到明显修复，新能源概念转债品种继续表现较好。

本报告期内，本基金谨慎投资股票市场，力争在风险可控的基础上增加收益，同时积极参与新股申购以增强投资收益。债券方面，本基金主要以利率债和高等级信用品种配置为主，组合保持适中的久期和杠杆，兼顾组合收益性和流动性。通过股债平衡的思路进行仓位管理，利用动态的仓位调整来控制回撤风险，同时加强个股个券深度研究，积极捕捉市场机会，力争为投资人取得稳定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平睿安混合 A 的份额净值增长率为 4.27%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%，太平睿安混合 C 的份额净值增长率为 4.01%，同期业绩比较基准为 0.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为债市可预期的利好将逐步增多：通胀预期与通胀数据均已见顶，货币政策持续与之“脱钩”；经济下行拐点到来，虽然经济韧性较强，下行速度较为缓慢，但是监管仍然收紧，对于地产和地方债务政策不断收紧，在“宽货币、紧信用”的大环境下结构性缺资产的矛盾仍旧存在；美国紧缩预期以曲线平坦化形式实现，进程或慢于预期。因此对于债市而言，在经济潜在增速不断下行的大趋势下，收益率虽然会受到供需、流动性、外围市场等各方面的扰动，但长期来看仍将跟随经济基本面下行的概率较大。权益市场方面，受益于资本市场深化改革带来的红利，权益市场结构性机会较多，上半年高景气行业板块的个股可能仍将是未来市场追捧的热点，同时也需要关注受益于经济复苏有实际业绩驱动的行业，下半年的市场风格可能更趋向于均衡。另外一方面，由于下半年经济下行压力将逐渐显现，同时外围流动性收紧的压力预期越来越强，前期涨幅过高板块需要结合企业盈利预期兑现情况提防估值收缩带来的回调风险。整体上，我们认为无风险利率下行仍是未来资本市场长期趋势，利率债以及高评级信用债未来将更加受益。对于权益市场，从股债比价角度，结合股市宏观流动性和微观流动性情况，现在市场整体处于中性位置，短期市场大概率还是延续前期的结构式行情，中长期角度，绩优股还是具备配置价值，密切关注盈利稳定性高的龙头白马的投资机会。

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。公司估值和产品委员会成员由主席负责，估值分委会常任委员由稽核风控部、投资部门（含权益投资部、专户业务部、固定收益投资部）、研究部、基金运营部等部门负责人担任；产品分委会常任委员由稽核风控部、销售部门（含市场销售部、机构客户部）、信息技术部、基金运营部、交易部、产品经理及其所在部门负责人、拟任基金

经理或投资经理及其所在部门负责人担任。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据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

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：太平睿安混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	4,076,878.27	16,444,559.40
结算备付金		4,229,154.66	3,861,792.35
存出保证金		68,193.47	60,988.40
交易性金融资产	6.4.7.2	889,421,455.47	423,529,010.14
其中：股票投资		208,070,722.01	127,235,259.14
基金投资		-	-
债券投资		681,350,733.46	296,293,751.00
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	5,000,000.00	39,960,137.48
应收证券清算款		3,893,749.65	-
应收利息	6.4.7.5	11,122,431.25	2,871,380.66
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		917,811,862.77	486,727,868.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		215,999,857.00	85,000,000.00
应付证券清算款		3,667,630.86	13,524,934.76
应付赎回款		180,263.14	489,589.93
应付管理人报酬		340,915.06	170,761.25
应付托管费		56,819.21	28,460.18
应付销售服务费		13,233.16	27,206.49
应付交易费用	6.4.7.7	116,065.79	150,687.73
应交税费		14,567.57	2,584.06
应付利息		23,769.37	27,002.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	96,384.53	128,230.04
负债合计		220,509,505.69	99,549,456.51
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	649,089,809.90	375,784,875.64
未分配利润	6.4.7.10	48,212,547.18	11,393,536.28
所有者权益合计		697,302,357.08	387,178,411.92
负债和所有者权益总计		917,811,862.77	486,727,868.43

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 649,089,809.90 份，其中 A 类基金份额总额

为 619,680,827.28 份，基金份额净值 1.0744 元；C 类基金份额总额为 29,408,982.62 份，基金份额净值 1.0710 元。

6.2 利润表

会计主体：太平睿安混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		27,681,030.20
1. 利息收入		8,753,936.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	33,370.68
债券利息收入		8,699,960.97
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		20,605.11
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,217,149.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	26,524,936.90
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13.1	-1,319,069.35
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-
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	2,011,282.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,313,206.77
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	23,150.25
减：二、费用		4,370,706.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,838,805.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	306,467.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	95,236.24
4. 交易费用	6.4.7.19	430,574.29
5. 利息支出		1,586,862.05
其中：卖出回购金融资产支出		1,586,862.05
6. 税金及附加		5,810.42
7. 其他费用	6.4.7.20	106,950.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,310,323.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,310,323.46

注：由于本基金于 2020 年 11 月 10 日成立，无上年度可比期间，因此利润表只列示 2021 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：太平睿安混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	375,784,875.64	11,393,536.28	387,178,411.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,310,323.46	23,310,323.46
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）	273,304,934.26	13,508,687.44	286,813,621.70
其中：1. 基金申购款	313,297,437.41	15,433,040.97	328,730,478.38
2. 基金赎回款	-39,992,503.15	-1,924,353.53	-41,916,856.68
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）	649,089,809.90	48,212,547.18	697,302,357.08

注：由于本基金于 2020 年 11 月 10 日成立，无上年度可比期间，因此该表只列示 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

尤象都	尤象都	孙波
-----	-----	----

基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人
----------	-----------	---------

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平睿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:股票资产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,本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的

业绩比较基准为：中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%。

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 2021 年 8 月 31 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平睿安混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2021 年 6 月 30 日的财务状况，以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日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

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 2020 年 11 月 10 日(基金合同生效日)至 2021 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股票投资和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卖出回购金融资产款和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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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

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。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。

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、托管费和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。

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

本基金同一类别的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、可交换债券和私募债券除外)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、可交换债券和私募债券除外),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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	4,076,878.27
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	4,076,878.27

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	214,100,433.64	208,070,722.01	-6,029,711.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	339,460,733.46	3,181,483.82
	银行间市场	341,890,000.00	2,364,216.85

	合计	675,805,032.79	681,350,733.46	5,545,700.67
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	889,905,466.43	889,421,455.47	-484,010.96

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2021年6月30日
应收活期存款利息	445.13
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	1,903.10
应收债券利息	11,120,052.32
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	30.70
合计	11,122,431.25

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	111,174.99
银行间市场应付交易费用	4,890.80
合计	116,065.79

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.25
应付证券出借违约金	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	36,876.91
合计	96,384.53

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

太平睿安混合 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	328,123,806.72	328,123,806.72
本期申购	305,652,988.68	305,652,988.68
本期赎回（以“-”号填列）	-14,095,968.12	-14,095,968.12
-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	619,680,827.28	619,680,827.28

太平睿安混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,661,068.92	47,661,068.92
本期申购	7,644,448.73	7,644,448.73
本期赎回（以“-”号填列）	-25,896,535.03	-25,896,535.03
-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	29,408,982.62	29,408,982.62
-----	---------------	---------------

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	2,302,175.14	7,675,941.47	9,978,116.61
本期利润	29,800,347.15	-8,022,522.41	21,777,824.74
本期基金份额 交易产生的变 动数	5,065,879.76	9,301,730.30	14,367,610.06
其中：基金申 购款	5,528,206.73	9,576,834.33	15,105,041.06
基金赎 回款	-462,326.97	-275,104.03	-737,431.00
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	37,168,402.05	8,955,149.36	46,123,551.41

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
上年度末	301,113.29	1,114,306.38	1,415,419.67
本期利润	1,823,183.08	-290,684.36	1,532,498.72
本期基金份额 交易产生的变 动数	-459,979.54	-398,943.08	-858,922.62
其中：基金申 购款	97,278.41	230,721.50	327,999.91
基金赎 回款	-557,257.95	-629,664.58	-1,186,922.53
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	1,664,316.83	424,678.94	2,088,995.77

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,822.48
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	20,842.46
其他	705.74

合计	33,370.68
----	-----------

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	130,309,239.38
减：卖出股票成本总额	103,784,302.48
买卖股票差价收入	26,524,936.90

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
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	154,663,109.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	154,310,411.39
减：应收利息总额	1,671,767.79
买卖债券差价收入	-1,319,069.35

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,011,282.41
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,011,282.41

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,313,206.77
股票投资	-12,681,382.98
债券投资	4,368,176.21
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	-8,313,206.77

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	23,150.25
合计	23,150.25

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	426,699.29
银行间市场交易费用	3,875.00
合计	430,574.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	28,646.87
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,596.01
债券账户维护费	10,800.00
开户费	400.00
合计	106,950.25

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
太平基金管理有限公司（“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

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于 2020 年 11 月 10 日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内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的债券回购交易。

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有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,838,805.84
其中：支付销售机构的客户维护费	75,287.81

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：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	306,467.65

注：支付基金托管人兴业银行的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。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平睿安混合 A	太平睿安混合 C	合计
太平基金管理有限公司	-	53,252.84	53,252.84
兴业银行	-	38,133.43	38,133.43
合计	-	91,386.27	91,386.27

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给太平基金，再由太平基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数。}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	4,076,878.27	11,822.48

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月21日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021年06月04日	2021年08月25日	新股锁定	-	27.42	108	0.00	2,961.36	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	833	27,672.26	72,887.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	541	26,287.19	48,900.99	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月01日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

			日							
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688059	华锐精密	2021年2月1日	2021年8月9日	新股锁定	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688092	爱科科技	2021年3月12日	2021年9月20日	新股锁定	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688345	博力威	2021年6月3日	2021年12月13日	新股锁定	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	-

			日							
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股流通受限	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股锁定	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股锁定	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688621	阳光诺和	2021年6月11日	2021年12月21日	新股锁定	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688660	电气风电	2021年5月11日	2021年11月19日	新股锁定	5.44	7.26	41,332	224,846.08	300,070.32	-
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	新股锁定	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53	-

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
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	7,990	799,000.00	799,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	260	26,000.00	26,000.00	-
113626	伯特转债	2021年6月30日	2021年7月21日	新债未上市	100.00	100.00	3,100	310,000.00	310,000.00	-
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	新债未上市	100.00	100.00	620	62,000.00	62,000.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监

高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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 2021 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 45,999,857.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
200212	20 国开 12	2021 年 7 月 1 日	100.50	490,000	49,245,000.00
合计				490,000	49,245,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 170,000,000.00 元，截至 2021 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中高风险、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、权证等。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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，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。

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	20,020,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	37,140,780.60	-
合计	57,160,780.60	-

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
--------	-------------------	---------------------

AAA	441,199,406.17	-
AAA 以下	52,428,546.69	-
未评级	130,562,000.00	-
合计	624,189,952.86	-

注：未评级债券为政策银行债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 215,999,857.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本

基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

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

算备用金和存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,076,878.27	-	-	-	4,076,878.27
结算备付金	4,229,154.66	-	-	-	4,229,154.66
存出保证金	68,193.47	-	-	-	68,193.47
交易性金融资产	188,403,733.46	492,947,000.00	-	-208,070,722.01	889,421,455.47
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	5,000,000.00
应收利息	-	-	-	11,122,431.25	11,122,431.25
应收证券清算款	-	-	-	3,893,749.65	3,893,749.65
资产总计	201,777,959.86	492,947,000.00	-	-223,086,902.91	917,811,862.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	180,263.14	180,263.14
应付管理人报酬	-	-	-	340,915.06	340,915.06
应付托管费	-	-	-	56,819.21	56,819.21
应付证券清算款	-	-	-	3,667,630.86	3,667,630.86
卖出回购金融资产款	215,999,857.00	-	-	-	215,999,857.00
应付销售服务费	-	-	-	13,233.16	13,233.16
应付交易费用	-	-	-	116,065.79	116,065.79
应付利息	-	-	-	23,769.37	23,769.37
应交税费	-	-	-	14,567.57	14,567.57
其他负债	-	-	-	96,384.53	96,384.53
负债总计	215,999,857.00	-	-	4,509,648.69	220,509,505.69
利率敏感度缺口	-14,221,897.14	492,947,000.00	-	-218,577,254.22	697,302,357.08
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,444,559.40	-	-	-	16,444,559.40
结算备付金	3,861,792.35	-	-	-	3,861,792.35
存出保证金	60,988.40	-	-	-	60,988.40
交易性金融资产	95,917,751.00	200,376,000.00	-	-127,235,259.14	423,529,010.14
买入返售金融资产	39,960,137.48	-	-	-	39,960,137.48
应收利息	-	-	-	2,871,380.66	2,871,380.66
资产总计	156,245,228.63	200,376,000.00	-	-130,106,639.80	486,727,868.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	489,589.93	489,589.93
应付管理人报酬	-	-	-	170,761.25	170,761.25
应付托管费	-	-	-	28,460.18	28,460.18
应付证券清算款	-	-	-	13,524,934.76	13,524,934.76
卖出回购金融资产款	85,000,000.00	-	-	-	85,000,000.00

应付销售服务费	-	-	-	27,206.49	27,206.49
应付交易费用	-	-	-	150,687.73	150,687.73
应付利息	-	-	-	27,002.07	27,002.07
应交税费	-	-	-	2,584.06	2,584.06
其他负债	-	-	-	128,230.04	128,230.04
负债总计	85,000,000.00	-	-	14,549,456.51	99,549,456.51
利率敏感度缺口	71,245,228.63	200,376,000.00	-	-115,557,183.29	387,178,411.92

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	该利率敏感性分析给予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降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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	4,188,186.76	-
	市场利率上升 25 个基点	-4,140,568.96	-

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-30%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	208,070,722.01	29.84	127,235,259.14	32.86
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	208,070,722.01	29.84	127,235,259.14	32.86

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	—		
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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	10,403,536.10	—

	沪深 300 指数下降 5%	-10,403,536.10	-
--	-------------------	----------------	---

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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	208,070,722.01	22.67
	其中：股票	208,070,722.01	22.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	681,350,733.46	74.24
	其中：债券	681,350,733.46	74.24
	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	5,000,000.00	0.54
	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	8,306,032.93	0.90
8	其他各项资产	15,084,374.37	1.64
9	合计	917,811,862.77	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	2,907,000.00	0.42
C	制造业	133,541,155.97	19.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,384,036.60	1.78
E	建筑业	4,675,371.37	0.67
F	批发和零售业	46,404.58	0.01
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	6,801,874.21	0.98
J	金融业	38,062,321.10	5.46

K	房地产业	5,952,500.00	0.85
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,653,025.15	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	35,742.75	0.01
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	208,070,722.01	29.84

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300298	三诺生物	569,920	17,849,894.40	2.56
2	601818	光大银行	2,000,000	7,560,000.00	1.08
3	600900	长江电力	350,000	7,224,000.00	1.04
4	002050	三花智控	300,000	7,194,000.00	1.03
5	000001	平安银行	310,000	7,012,200.00	1.01
6	600519	贵州茅台	3,200	6,581,440.00	0.94
7	603501	韦尔股份	20,000	6,440,000.00	0.92
8	601012	隆基股份	70,000	6,218,800.00	0.89
9	601988	中国银行	2,000,000	6,160,000.00	0.88
10	000002	万科A	250,000	5,952,500.00	0.85
11	002966	苏州银行	800,000	5,880,000.00	0.84
12	603986	兆易创新	30,000	5,637,000.00	0.81
13	002250	联化科技	200,000	5,580,000.00	0.80
14	300750	宁德时代	10,000	5,348,000.00	0.77
15	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.74
16	601318	中国平安	80,000	5,142,400.00	0.74
17	603596	伯特利	140,000	5,005,000.00	0.72
18	002460	赣锋锂业	40,000	4,843,600.00	0.69
19	000786	北新建材	120,000	4,710,000.00	0.68
20	601668	中国建筑	1,000,000	4,650,000.00	0.67
21	300529	健帆生物	50,000	4,318,000.00	0.62
22	688158	优刻得	110,000	4,317,500.00	0.62
23	601233	桐昆股份	170,000	4,095,300.00	0.59
24	300059	东方财富	120,000	3,934,800.00	0.56

25	600690	海尔智家	150,000	3,886,500.00	0.56
26	300760	迈瑞医疗	8,000	3,840,400.00	0.55
27	000895	双汇发展	120,000	3,816,000.00	0.55
28	688981	中芯国际	60,000	3,709,200.00	0.53
29	600887	伊利股份	100,000	3,683,000.00	0.53
30	002756	永兴材料	60,000	3,563,400.00	0.51
31	300676	华大基因	30,000	3,558,000.00	0.51
32	300723	一品红	100,000	3,375,000.00	0.48
33	000333	美的集团	46,000	3,283,020.00	0.47
34	002601	龙佰集团	89,925	3,109,606.50	0.45
35	601899	紫金矿业	300,000	2,907,000.00	0.42
36	000651	格力电器	50,000	2,605,000.00	0.37
37	002241	歌尔股份	50,000	2,137,000.00	0.31
38	002415	海康威视	30,000	1,935,000.00	0.28
39	600486	扬农化工	17,000	1,900,090.00	0.27
40	000636	风华高科	50,000	1,511,000.00	0.22
41	002439	启明星辰	50,000	1,450,500.00	0.21
42	600919	江苏银行	200,000	1,420,000.00	0.20
43	002064	华峰化学	99,919	1,418,849.80	0.20
44	688598	金博股份	5,000	1,345,000.00	0.19
45	600409	三友化工	100,000	1,011,000.00	0.14
46	600588	用友网络	30,000	997,800.00	0.14
47	601336	新华保险	20,000	918,200.00	0.13
48	600176	中国巨石	57,150	886,396.50	0.13
49	688063	派能科技	1,890	371,952.00	0.05
50	688660	电气风电	41,332	300,070.32	0.04
51	688161	威高骨科	2,700	286,335.00	0.04
52	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.04
53	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.02
54	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.02
55	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.02
56	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.01
57	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.01
58	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
59	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.01
60	300979	华利集团	833	72,887.50	0.01
61	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
62	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.01
63	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
64	300981	中红医疗	541	48,900.99	0.01
65	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
66	300894	火星人	628	42,704.00	0.01

67	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
68	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
69	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
70	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
71	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
72	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
73	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
74	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
75	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
76	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
77	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
78	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
79	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
80	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
81	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
82	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
83	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
84	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
85	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
86	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
87	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
88	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
89	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
90	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
91	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
92	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
93	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
94	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
95	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
96	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
97	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
98	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
99	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
100	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
101	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
102	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
103	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
104	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
105	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
106	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
107	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
108	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00

109	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
110	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
111	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
112	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
113	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
114	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
115	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
116	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
117	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
118	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
119	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
120	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300298	三诺生物	13,683,413.00	3.53
2	601012	隆基股份	7,777,037.00	2.01
3	002250	联化科技	7,747,770.00	2.00
4	600519	贵州茅台	7,605,266.00	1.96
5	002050	三花智控	6,592,551.40	1.70
6	002966	苏州银行	6,316,000.00	1.63
7	688158	优刻得	5,976,283.88	1.54
8	603501	韦尔股份	5,864,230.60	1.51
9	300601	康泰生物	5,736,145.04	1.48
10	000786	北新建材	5,368,099.00	1.39
11	002460	赣锋锂业	5,211,062.00	1.35
12	300529	健帆生物	5,002,601.00	1.29
13	603596	伯特利	4,818,955.80	1.24
14	600690	海尔智家	4,804,573.00	1.24
15	601899	紫金矿业	4,708,501.00	1.22
16	603986	兆易创新	4,700,119.80	1.21
17	300676	华大基因	4,514,448.00	1.17
18	000002	万科A	4,289,739.00	1.11
19	601318	中国平安	4,261,083.00	1.10
20	601233	桐昆股份	4,240,110.00	1.10

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	601398	工商银行	7,712,000.00	1.99
2	000858	五粮液	6,365,448.00	1.64
3	300601	康泰生物	6,027,606.00	1.56
4	000002	万科A	5,435,965.00	1.40
5	601888	中国中免	5,382,289.00	1.39
6	600519	贵州茅台	5,216,501.00	1.35
7	300124	汇川技术	5,032,652.00	1.30
8	603799	华友钴业	4,470,756.00	1.15
9	600887	伊利股份	4,426,427.70	1.14
10	300760	迈瑞医疗	4,354,001.00	1.12
11	000568	泸州老窖	4,125,001.00	1.07
12	601009	南京银行	3,973,420.00	1.03
13	601108	财通证券	3,801,222.00	0.98
14	300750	宁德时代	3,579,000.00	0.92
15	002304	洋河股份	3,019,425.00	0.78
16	600905	三峡能源	3,015,715.00	0.78
17	002250	联化科技	2,786,536.00	0.72
18	300059	东方财富	2,724,952.00	0.70
19	601939	建设银行	2,640,000.00	0.68
20	688536	思瑞浦	2,562,786.30	0.66

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	197,301,148.33
卖出股票收入（成交）总额	130,309,239.38

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	37,140,780.60	5.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	423,191,000.00	60.69
	其中：政策性金融债	130,562,000.00	18.72
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,020,000.00	2.87
6	中期票据	130,052,000.00	18.65
7	可转债（可交换债）	70,946,952.86	10.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	681,350,733.46	97.71
----	----	----------------	-------

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	200212	20 国开 12	900,000	90,450,000.00	12.97
2	200207	20 国开 07	400,000	40,112,000.00	5.75
3	019645	20 国债 15	370,260	37,140,780.60	5.33
4	155814	19 兴业 G1	300,000	30,270,000.00	4.34
5	175174	20 招证 G4	300,000	30,195,000.00	4.33

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投资。

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投资。

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 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、处罚的情况

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、招商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公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资

决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

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	68,193.47
2	应收证券清算款	3,893,749.65
3	应收股利	-
4	应收利息	11,122,431.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,084,374.37

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	128131	崇达转 2	6,655,786.00	0.95
2	113044	大秦转债	6,174,600.00	0.89
3	113611	福 20 转债	5,162,700.00	0.74
4	128081	海亮转债	4,548,400.00	0.65
5	128129	青农转债	4,410,753.36	0.63
6	113602	景 20 转债	3,526,281.30	0.51
7	128136	立讯转债	3,481,133.70	0.50
8	113037	紫银转债	3,424,212.30	0.49
9	127016	鲁泰转债	2,365,000.00	0.34
10	123049	维尔转债	2,157,200.00	0.31
11	110056	亨通转债	2,129,394.40	0.31
12	123025	精测转债	2,101,055.40	0.30
13	123090	三诺转债	2,035,755.00	0.29
14	113582	火炬转债	1,988,640.00	0.29
15	113017	吉视转债	1,952,400.00	0.28
16	127027	靖远转债	1,128,651.28	0.16
17	127006	敖东转债	266,866.10	0.04
18	128123	国光转债	219,584.47	0.03
19	113603	东缆转债	18,246.40	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末不存在指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
太平睿安混合 A	169	3,666,750.46	613,585,964.16	99.0165	6,094,863.12	0.9835
太平睿安混合 C	117	251,358.83	13,000,126.39	44.2046	16,408,856.23	55.7954
合计	277	2,343,284.51	626,586,090.55	96.5330	22,503,719.35	3.4670

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	太平睿安混合 A	21,427.92	0.0035
	太平睿安混合 C	23,027.29	0.0783
	合计	44,455.21	0.0068

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

基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	-
	太平睿安混合 C	-
	合计	-

§ 9 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	328,123,806.72	47,661,068.92
本报告期基金总申购份额	305,652,988.68	7,644,448.73
减：本报告期基金总赎回份额	14,095,968.12	25,896,535.03
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	619,680,827.28	29,408,982.62

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况

本报告期，基金管理人无重大人事变动情况。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉

及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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	
东吴证券	1	52,908,223.52	16.76%	38,691.62	16.13%	-
海通证券股份有限公司	1	35,632,492.75	11.29%	26,058.06	10.86%	-
兴业证券股份有限公司	2	33,850,446.12	10.73%	31,524.97	13.14%	-
东方证券	2	30,835,861.63	9.77%	22,123.89	9.22%	-
光大证券股份有限公司	1	28,931,626.88	9.17%	21,158.30	8.82%	-
东北证券股份有限公司	1	25,627,433.90	8.12%	18,741.42	7.81%	-
华创证券有限责任公司	2	23,721,589.27	7.52%	17,067.17	7.11%	-
招商证券	1	21,110,426.69	6.69%	19,659.90	8.20%	-
长江证券	2	14,315,930.23	4.54%	10,242.24	4.27%	-
申万宏源证	1	12,528,971.20	3.97%	8,911.92	3.71%	-

券						
广发证券	1	10,321,707.46	3.27%	7,341.62	3.06%	-
中银国际证 券股份有限 公司	1	5,004,120.76	1.59%	3,559.57	1.48%	-
华泰证券	1	2,512,551.66	0.80%	1,787.23	0.75%	-
中泰证券	1	184,722.53	0.06%	135.07	0.06%	-
天风证券	1	18,119,261.57	5.74%	12,888.66	5.37%	-
中信建投	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

本期新增海通证券 1 个交易单元，申万宏源证券 1 个交易单元，长江证券 1 个交易单元，华创证券 1 个交易单元，东方证券 2 个交易单元，东北证券 1 个交易单元，华泰证券 1 个交易单元，安信证券 1 个交易单元，兴业证券 1 个交易单元，天风证券 1 个交易单元，招商证券 1 个交易单元，东吴证券 1 个交易单元，中信建投证券 1 个交易单元。

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	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期权

		成交总额的 比例		回购 成交总额的 比例		证 成交总额的 比例
东吴证券	26,904,373.00	9.66%	784,000,000.00	27.74%	-	-
海通证券 股份有限 公司	10,146,650.82	3.64%	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	5,781,944.90	2.07%	-	-	-	-
东方证券	3,889,039.03	1.40%	185,000,000.00	6.55%	-	-
光大证券 股份有限 公司	16,043,347.30	5.76%	536,600,000.00	18.99%	-	-
东北证券 股份有限 公司	8,863,561.30	3.18%	725,000,000.00	25.65%	-	-
华创证券 有限责任 公司	41,754,453.00	14.98%	311,800,000.00	11.03%	-	-
招商证券	22,991,757.90	8.25%	246,000,000.00	8.70%	-	-
长江证券	6,024,560.80	2.16%	31,000,000.00	1.10%	-	-
申万宏源 证券	8,254,777.61	2.96%	-	-	-	-
广发证券	12,828,039.21	4.60%	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	21,478,232.85	7.71%	-	-	-	-
华泰证券	530,314.28	0.19%	-	-	-	-
中泰证券	947,158.30	0.34%	7,000,000.00	0.25%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中原证券	90,599,400.00	32.51%	-	-	-	-
天风证券	1,618,122.23	0.58%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加阳光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	指定报刊、基金管理人网站	2021年06月22日
2	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售(深圳)有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021年06月24日

3	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	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 02 月 04 日
4	太平睿安混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 22 日
5	太平睿安混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 20 日
6	太平睿安混合型证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 1 号	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 20 日
7	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	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 23 日
8	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加民商基金销售（上海）有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 14 日
9	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	指定报刊、基金管理人网站	2021 年 04 月 30 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	20210101—20210127	99,999,000.00	-	-	99,999,000.00	15.4060
机构	2	20210101—20210127	99,999,972.22	-	-	99,999,972.22	15.4062
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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日