

太平睿享混合型证券投资基金

2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 月 31 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 4 月 22 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 04 月 18 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 01 月 01 日起至 2024 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-----------------|--|----------------|
| 基金简称 | 太平睿享混合 | |
| 基金主代码 | 013260 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 17 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 509,359,229.43 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 | 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。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×5% | |
| 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。本基金可能投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | |
| 基金管理人 | 太平基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 太平睿享混合 A | 太平睿享混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013260 | 013261 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 501,498,993.61 份 | 7,860,235.82 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 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|-----------------|
| | 太平睿享混合 A | 太平睿享混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -2, 833, 687. 71 | -217, 128. 97 |
| 2. 本期利润 | 1, 708, 236. 93 | -470, 241. 68 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0032 | -0. 0269 |
| 4. 期末基金资产净值 | 493, 055, 462. 22 | 7, 630, 587. 32 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0. 9832 | 0. 9708 |

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。

3.2 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

太平睿享混合 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 | 0. 38% | 0. 37% | 1. 53% | 0. 20% | -1. 15% | 0. 17% |
| 过去六个月 | -0. 59% | 0. 32% | 0. 78% | 0. 19% | -1. 37% | 0. 13% |
| 过去一年 | -1. 00% | 0. 28% | -0. 12% | 0. 18% | -0. 88% | 0. 10% |
| 自基金合同生效起至今 | -1. 68% | 0. 28% | -1. 96% | 0. 21% | 0. 28% | 0. 07% |

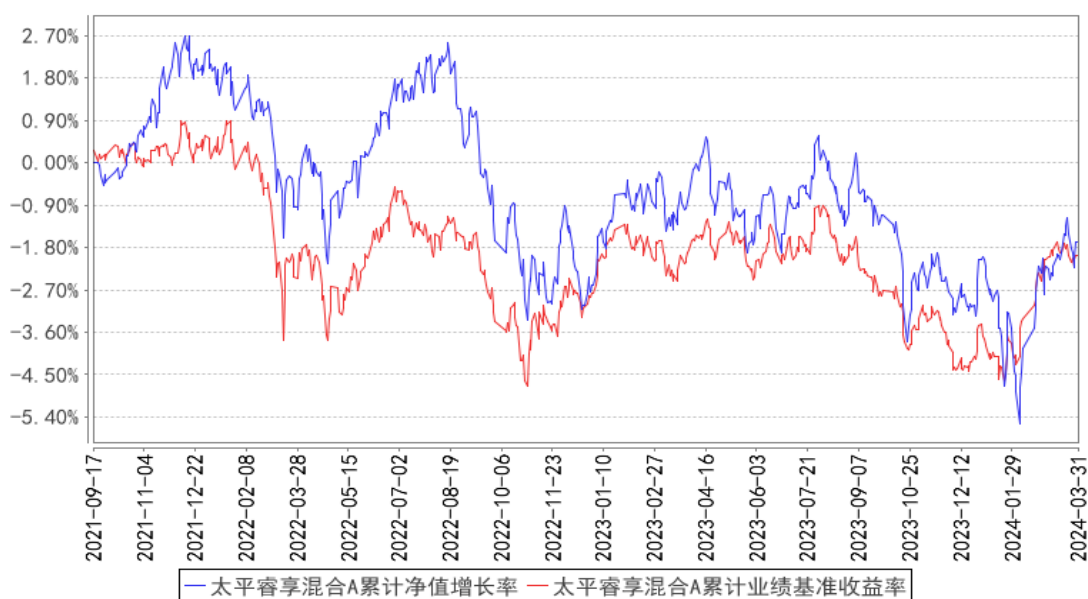
太平睿享混合 C

| 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 | 0. 25% | 0. 37% | 1. 53% | 0. 20% | -1. 28% | 0. 17% |

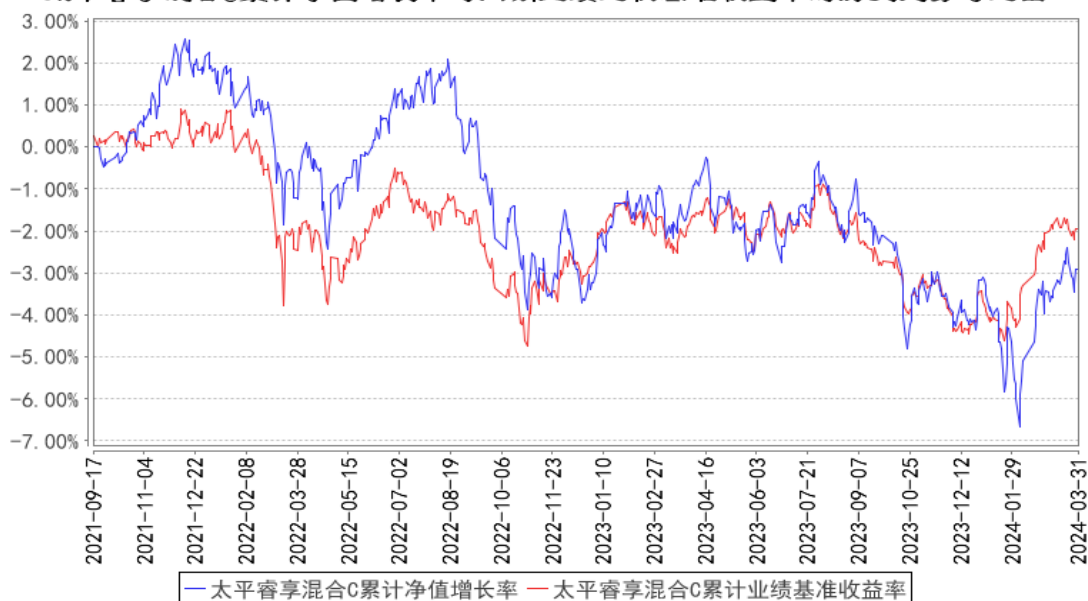
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月 | -0.84% | 0.32% | 0.78% | 0.19% | -1.62% | 0.13% |
| 过去一年 | -1.50% | 0.28% | -0.12% | 0.18% | -1.38% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.92% | 0.28% | -1.96% | 0.21% | -0.96% | 0.07% |

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

太平睿享混合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



太平睿享混合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 2021 年 9 月 17 日，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 | 2021年9月17 日 | - | 13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 | 2021年9月17 日 | - | 10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 年一季度我国经济数据呈现企稳改善趋势，3 月制造业 PMI 为 50.8%（前值 49.1%），延续了 1-2 月的环比改善。但是，近期部分事件性因素，如汇率波动、中美关系等在前期指数持续上行一段时间后仍对投资者风险偏好带来一定影响。结构上看，出口和基建是主要驱动力，与日常生活需求有关的服务行业景气度和地产依然偏弱。随着积极的广义赤字水平，财政、基建、消

费等政策的加快推进，通胀企稳概率较大，经济阶段性改善仍将延续。

股票市场一季度先抑后扬，上证指数、沪深 300 年初至今实现正收益，风格方面大盘表现好于小盘。尤其红利指数前期表现较好，一季度后半段有色金属板块在黄金大涨的带动下涨幅明显。科技板块中 AI 相关也有所表现但前期跌幅较多，汽车板块受益于政策刺激以及新车上市市场关注度较高。

债券市场一季度表现强劲，尤其超长端利率债收益率下行幅度明显。两会将全年经济增长目标定在“5%左右”，赤字率 3%配合 3.8 万亿专项债加上 1 万亿长期特别国债，财政整体稳健。由于一季度整体债券供给偏少，叠加市场整体风险偏好较低，银行保险机构对于债券需求强劲，货币政策宽松，配置压力和交易盘共同推动收益率曲线整体下行。二季度债市存在一些中短期扰动因素：一是特别国债二季度带来供给压力；二是经济阶段性改善；三是地产政策的优化调整。

本报告期内，本基金保持相对较低的权益仓位，风格相对偏向价值，一季度调仓较少，持仓继续以价值板块为主，转债加仓偏债性转债；纯债方面获利了结部分仓位，仍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，太平睿享混合 A 的份额净值增长率为 0.38%，同期业绩比较基准收益率为 1.53%；太平睿享混合 C 的份额净值增长率为 0.25%，同期业绩比较基准收益率为 1.53%。

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 | 80,706,203.56 | 12.22 |
| | 其中：股票 | 80,706,203.56 | 12.22 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 554,807,802.49 | 83.97 |
| | 其中：债券 | 524,280,012.35 | 79.35 |
| | 资产支持证券 | 30,527,790.14 | 4.62 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 6,800,665.76 | 1.03 |
| | 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 | 9,118,183.75 | 1.38 |
| 8 | 其他资产 | 9,267,442.35 | 1.40 |
| 9 | 合计 | 660,700,297.91 | 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 | 928,340.60 | 0.19 |
| C | 制造业 | 25,388,799.49 | 5.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,534,975.00 | 1.11 |
| E | 建筑业 | 5,693,415.00 | 1.14 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 21,241.10 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 6,536.72 | 0.00 |
| J | 金融业 | 5,242,504.00 | 1.05 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,097.60 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,252,000.00 | 0.85 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 47,070,909.51 | 9.40 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 原材料 | - | - |
| 非日常生活消费品 | 7,252,381.87 | 1.45 |
| 日常消费品 | 1,824,159.91 | 0.36 |
| 能源 | 1,544,108.48 | 0.31 |
| 金融 | 7,045,275.99 | 1.41 |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | 2,209,588.71 | 0.44 |
| 信息技术 | 893,314.37 | 0.18 |
| 通信服务 | 3,852,266.38 | 0.77 |
| 公用事业 | 9,014,198.34 | 1.80 |

| | | |
|-----|---------------|------|
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 33,635,294.05 | 6.72 |

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 | 584,000 | 8,024,160.00 | 1.60 |
| 2 | 06862 | 海底捞 | 453,000 | 7,252,381.87 | 1.45 |
| 3 | 600502 | 安徽建工 | 1,173,900 | 5,693,415.00 | 1.14 |
| 4 | 002039 | 黔源电力 | 300,000 | 4,800,000.00 | 0.96 |
| 5 | 601336 | 新华保险 | 160,000 | 4,771,200.00 | 0.95 |
| 6 | 605589 | 圣泉集团 | 242,900 | 4,595,668.00 | 0.92 |
| 7 | 300347 | 泰格医药 | 80,000 | 4,252,000.00 | 0.85 |
| 8 | 01816 | 中广核电力 | 1,928,000 | 4,054,961.89 | 0.81 |
| 9 | 603878 | 武进不锈 | 450,000 | 3,991,500.00 | 0.80 |
| 10 | 02380 | 中国电力 | 1,340,000 | 3,899,434.17 | 0.78 |

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 | 122,611,054.93 | 24.49 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,330,147.54 | 6.06 |
| 4 | 企业债券 | 142,873,603.84 | 28.54 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 20,513,753.01 | 4.10 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 217,134,383.08 | 43.37 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 21,147,217.49 | 4.22 |
| 10 | 合计 | 524,280,012.35 | 104.71 |

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 | 137744 | 22 上证 02 | 400,000 | 40,691,945.20 | 8.13 |
| 2 | 137639 | 22 西南 03 | 300,000 | 30,554,847.12 | 6.10 |
| 3 | 163221 | 20 诚通 03 | 300,000 | 30,339,333.70 | 6.06 |
| 4 | 092218005 | 22 农发清发 05 | 300,000 | 30,330,147.54 | 6.06 |
| 5 | 232380021 | 23 浙商银行二级资本债 01 | 200,000 | 21,147,217.49 | 4.22 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 183269 | 铁托 4 优 | 200,000 | 20,289,387.40 | 4.05 |
| 2 | 193481 | 21 工鑫 7A | 100,000 | 10,238,402.74 | 2.04 |

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，浙商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。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 | 634,734.50 |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,632,707.85 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 9,267,442.35 |

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 | 16,717,629.42 | 3.34 |
| 2 | 113056 | 重银转债 | 14,774,082.92 | 2.95 |
| 3 | 128138 | 侨银转债 | 12,300,801.99 | 2.46 |
| 4 | 128042 | 凯中转债 | 9,290,019.79 | 1.86 |
| 5 | 110063 | 鹰 19 转债 | 7,904,040.11 | 1.58 |
| 6 | 113623 | 风 21 转债 | 7,894,355.59 | 1.58 |
| 7 | 123146 | 中环转 2 | 7,199,599.96 | 1.44 |
| 8 | 127032 | 苏行转债 | 6,943,126.53 | 1.39 |
| 9 | 113058 | 友发转债 | 6,832,928.49 | 1.36 |
| 10 | 127045 | 牧原转债 | 6,154,830.42 | 1.23 |
| 11 | 123076 | 强力转债 | 6,106,499.31 | 1.22 |
| 12 | 113530 | 大丰转债 | 6,001,819.44 | 1.20 |
| 13 | 118028 | 会通转债 | 5,848,818.08 | 1.17 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 14 | 113050 | 南银转债 | 5,698,246.58 | 1.14 |
| 15 | 127016 | 鲁泰转债 | 5,401,214.93 | 1.08 |
| 16 | 110062 | 烽火转债 | 4,338,485.59 | 0.87 |
| 17 | 127034 | 绿茵转债 | 4,211,216.34 | 0.84 |
| 18 | 110086 | 精工转债 | 4,138,046.45 | 0.83 |
| 19 | 110087 | 天业转债 | 4,101,275.94 | 0.82 |
| 20 | 128106 | 华统转债 | 3,690,156.16 | 0.74 |
| 21 | 113532 | 海环转债 | 3,478,014.85 | 0.69 |
| 22 | 123174 | 精锻转债 | 3,413,379.45 | 0.68 |
| 23 | 128129 | 青农转债 | 3,126,180.00 | 0.62 |
| 24 | 127042 | 嘉美转债 | 3,020,840.76 | 0.60 |
| 25 | 128049 | 华源转债 | 2,873,406.99 | 0.57 |
| 26 | 123107 | 温氏转债 | 2,776,271.92 | 0.55 |
| 27 | 128105 | 长集转债 | 2,417,615.07 | 0.48 |
| 28 | 127039 | 北港转债 | 2,399,898.63 | 0.48 |
| 29 | 127082 | 亚科转债 | 2,393,984.40 | 0.48 |
| 30 | 123212 | 立中转债 | 2,260,061.37 | 0.45 |
| 31 | 113033 | 利群转债 | 2,211,415.40 | 0.44 |
| 32 | 127044 | 蒙娜转债 | 2,192,973.96 | 0.44 |
| 33 | 128119 | 龙大转债 | 2,041,876.58 | 0.41 |
| 34 | 113527 | 维格转债 | 1,763,506.85 | 0.35 |
| 35 | 113054 | 绿动转债 | 1,669,376.44 | 0.33 |
| 36 | 128066 | 亚泰转债 | 1,258,626.44 | 0.25 |
| 37 | 127084 | 柳工转 2 | 1,245,043.84 | 0.25 |
| 38 | 132026 | G 三峡 EB2 | 1,210,184.10 | 0.24 |
| 39 | 127086 | 恒邦转债 | 1,205,984.38 | 0.24 |
| 40 | 127074 | 麦米转 2 | 1,170,440.06 | 0.23 |
| 41 | 127091 | 科数转债 | 1,166,501.91 | 0.23 |
| 42 | 128087 | 孚日转债 | 1,157,542.47 | 0.23 |
| 43 | 123104 | 卫宁转债 | 1,135,326.03 | 0.23 |
| 44 | 113640 | 苏利转债 | 1,124,405.18 | 0.22 |
| 45 | 127051 | 博杰转债 | 1,089,858.90 | 0.22 |
| 46 | 123109 | 昌红转债 | 1,074,771.20 | 0.21 |
| 47 | 113656 | 嘉诚转债 | 1,072,658.63 | 0.21 |
| 48 | 123115 | 捷捷转债 | 1,061,709.59 | 0.21 |
| 49 | 123165 | 回天转债 | 1,045,009.59 | 0.21 |
| 50 | 123154 | 火星转债 | 1,028,519.18 | 0.21 |
| 51 | 123193 | 海能转债 | 1,012,921.10 | 0.20 |
| 52 | 128117 | 道恩转债 | 1,006,275.51 | 0.20 |
| 53 | 123190 | 道氏转 02 | 944,060.55 | 0.19 |
| 54 | 128125 | 华阳转债 | 700,005.11 | 0.14 |
| 55 | 113516 | 苏农转债 | 655,624.93 | 0.13 |

| | | | | |
|----|--------|---------|------------|------|
| 56 | 127040 | 国泰转债 | 650,894.63 | 0.13 |
| 57 | 128130 | 景兴转债 | 594,402.85 | 0.12 |
| 58 | 113524 | 奇精转债 | 566,417.12 | 0.11 |
| 59 | 113644 | 艾迪转债 | 541,523.29 | 0.11 |
| 60 | 113636 | 甬金转债 | 536,005.62 | 0.11 |
| 61 | 111010 | 立昂转债 | 533,756.16 | 0.11 |
| 62 | 118000 | 嘉元转债 | 525,208.22 | 0.10 |
| 63 | 113633 | 科沃转债 | 519,136.99 | 0.10 |
| 64 | 113657 | 再 22 转债 | 509,858.22 | 0.10 |
| 65 | 118031 | 天 23 转债 | 506,007.53 | 0.10 |
| 66 | 118005 | 天奈转债 | 502,051.37 | 0.10 |
| 67 | 118022 | 锂科转债 | 490,642.47 | 0.10 |
| 68 | 113653 | 永 22 转债 | 480,040.28 | 0.10 |
| 69 | 123145 | 药石转债 | 365,747.12 | 0.07 |
| 70 | 128071 | 合兴转债 | 284,353.10 | 0.06 |
| 71 | 110092 | 三房转债 | 281,289.45 | 0.06 |

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 | 太平睿享混合 A | 太平睿享混合 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 555,229,597.51 | 28,223,649.31 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,320.71 | 2,253.83 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 53,733,924.61 | 20,365,667.32 |
| 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 | 501,498,993.61 | 7,860,235.82 |

§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 | 20240101-20240331 | 452, 214, 590. 69 | - | - | 452, 214, 590. 69 | 88. 7811 |
| 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、《太平睿享混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平睿享混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平睿享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 4 月 22 日