

太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 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 2022 年 04 月 29 日（基金合同生效日）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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49

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	49
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	太平中证 1000 指数增强	
基金主代码	015466	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 4 月 29 日	
基金管理人	太平基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,733,491.75 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	太平中证 1000 指数增强 A	太平中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015466	015467
报告期末下属分级基金的份额总额	47,705,208.78 份	1,028,282.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	主要投资策略包括股票投资策略，债券投资策略，衍生品投资策略，资产支持证券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略。 本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在控制跟踪误差的基础上，力争获得相对基准的超额收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金；同时，本基金跟踪标的指数，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金还将通过港股通渠道投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵霖
	联系电话	021-38556613
		陆志俊
		95559

电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话	021-61560999/400-028-8699	95559
传真	021-38556677	021-62701216
注册地址	上海市虹口区邯郸路 135 号 5 幢 101 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	焦艳军	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.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	2022 年 04 月 29 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日	
	太平中证 1000 指数增强 A	太平中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	3,498,841.21	49,271.57
本期利润	4,247,547.88	39,607.87
加权平均基金份额本期利润	0.0347	0.0855
本期加权平均净值利润率	3.44%	8.19%
本期基金份额净值增长率	10.77%	10.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利	4,017,556.62	85,705.10

润		
期末可供分配基金份额利润	0.0842	0.0833
期末基金资产净值	52,842,397.02	1,138,111.10
期末基金份额净值	1.1077	1.1068
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.77%	10.68%

注：1、本基金基金合同生效日为 2022 年 4 月 29 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。

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

太平中证 1000 指数增强 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	10.50%	1.14%	9.59%	1.24%	0.91%	-0.10%
自基金合同生效起至今	10.77%	0.84%	25.83%	1.36%	-15.06%	-0.52%

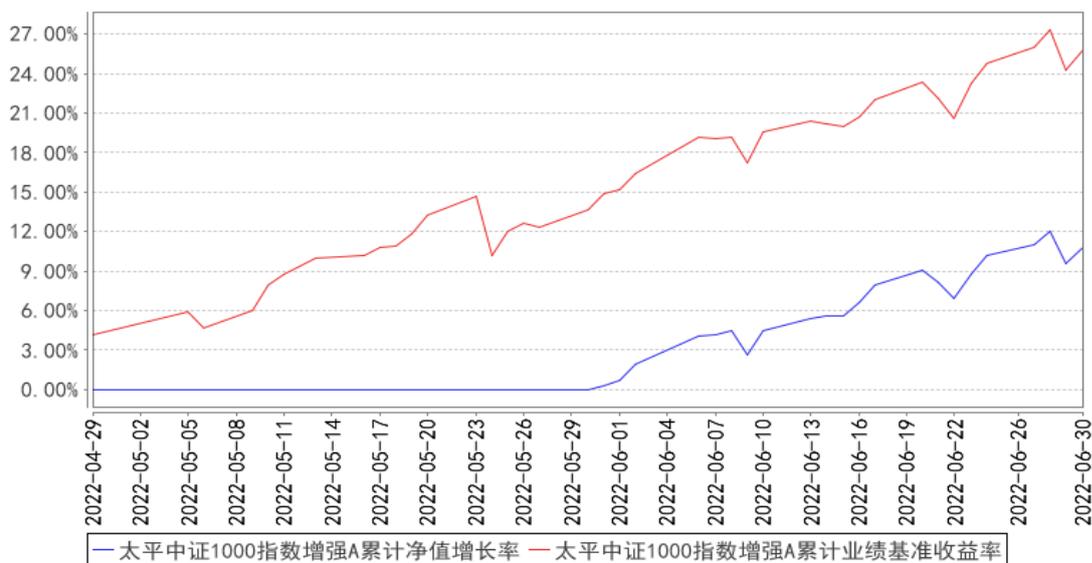
太平中证 1000 指数增强 C

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	10.47%	1.14%	9.59%	1.24%	0.88%	-0.10%

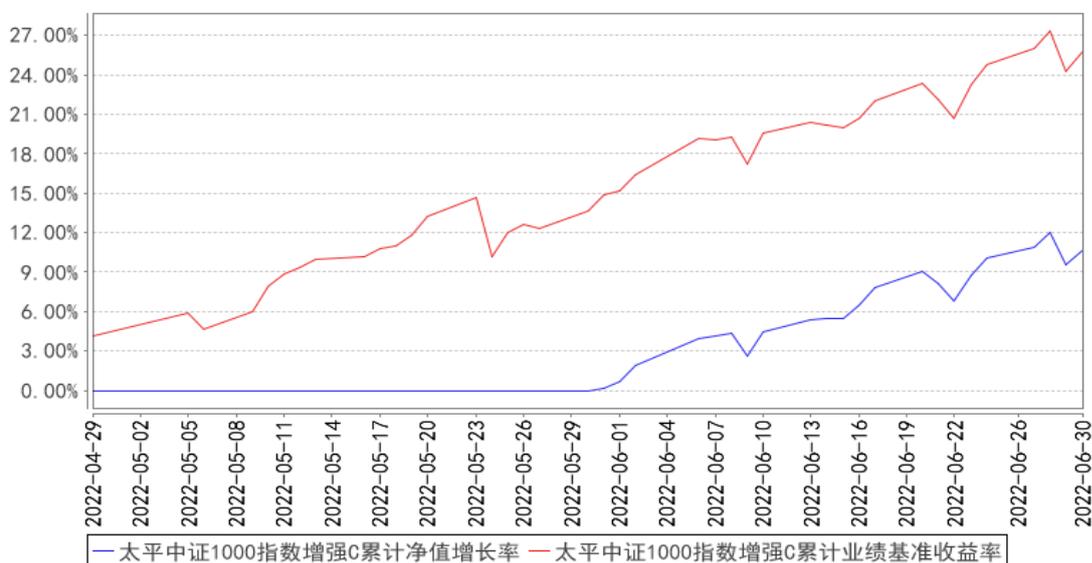
自基金合同生效起 至今	10.68%	0.84%	25.83%	1.36%	-15.15 %	-0.52%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------------	--------

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

太平中证1000指数增强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



太平中证1000指数增强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 2022 年 4 月 29 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。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 28 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、太平智行三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、太平智远三个月定期开放股票型发起式证券投资基金、太平睿享混合型证券投资基金、太平丰润一年定期开放债券型发起式证券投资基金、太平恒兴纯债债券型证券投资基金、太平睿庆混合型证券投资基金、太平中证 1000 指数增强型证券投资基金、太平安元债券型证券投资基金、太平嘉和三个月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		
张子权	本基金的基金经理、太平嘉和三个	2022 年 4 月 29 日	-	5 年	英国莱斯特大学理学硕士，具有证券投资基金从业资格。2016 年起先后任职于国金证券上海资产管理分公司、太平资产管理有限公司，历任量化研究员、助理投资经

	月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理				理、投资经理等职。2021 年 11 月加入本公司，从事量化投资研究工作。2022 年 4 月 29 日起担任太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理。2022 年 6 月 27 日起担任太平嘉和三个月定期开放债券型发起式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。

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 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。

4.3.2 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

本基金跟踪的标的指数为中证 1000 指数，业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。本基金股票投资方面主要采用指数增强量化投资策略，在控制跟踪误

差的基础上，力争获得相对基准的超额收益。报告期内产品于 6 月 1 日基本完成建仓。在基金基本完成建仓后，业绩领先基准，并有效控制了跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，太平中证 1000 指数增强 A 的净值收益率为 10.77%，同期业绩比较基准为 25.83%；太平中证 1000 指数增强 C 的净值收益率为 10.68%，同期业绩比较基准为 25.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，中小盘股票的估值依旧处于历史相对低位，具备较好的投资性价比。随着中国经济的复苏，我们需要关注市场在行业上的结构性机会，对于前期关注度较高的新能源等行业，同时也要保持较敏锐的风险意识。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及《太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的约定：在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

本基金管理人在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

2022 上半年度，基金托管人在太平中证 1000 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2022 上半年度，太平基金管理有限公司在太平中证 1000 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人在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。

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

2022 上半年度，由太平基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关太平中证 1000 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：太平中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	4,461,659.92
结算备付金		462,565.78
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	49,473,660.38
其中：股票投资		49,473,660.38
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		569,699.80
应收股利		-
应收申购款		199,216.72
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		55,166,802.60
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		383,176.89
应付赎回款		657,970.95
应付管理人报酬		35,752.66
应付托管费		5,362.92
应付销售服务费		171.00
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	103,860.06
负债合计		1,186,294.48
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	48,733,491.75
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	5,247,016.37
净资产合计		53,980,508.12
负债和净资产总计		55,166,802.60

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 48,733,491.75 份，其中 A 类基金份额总额为 47,705,208.78 份，基金份额净值 1.1077 元；C 类基金份额总额为 1,028,282.97 份，基金份额净值 1.1068 元。

2、由于本基金于 2022 年 4 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：太平中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 4 月 29 日（基金合同 生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,579,171.78
1. 利息收入		266,465.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	266,465.27
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,573,022.39
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,473,541.02
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	99,481.37
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）	6.4.7.20	739,042.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	641.15
减：二、营业总支出		292,016.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	218,256.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,738.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	321.24
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	40,699.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号		4,287,155.75

填列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,287,155.75
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		4,287,155.75

注：由于本基金于 2022 年 4 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：太平中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 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）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	208,253,076.92	-	-	208,253,076.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-159,519,585.17	-	5,247,016.37	-154,272,568.80
（一）、综合收益总额	-	-	4,287,155.75	4,287,155.75
（二）、本期基金份额交易产生的基	-159,519,585.17	-	959,860.62	-158,559,724.55

金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	11,998,878.83	-	1,017,896.17	13,016,775.00
2. 基金赎回款	-171,518,464.00	-	-58,035.55	-171,576,499.55
(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、本期末净资产(基金净值)	48,733,491.75	-	5,247,016.37	53,980,508.12

注：由于本基金于 2022 年 4 月 29 日成立，无上年度可比期间数据。

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：

<u>范宇</u>	<u>史彦刚</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平中证 1000 指数增强型证券投资基金(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 2022[474]号《关于准予太平中证 1000 指数增强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《太平中证 1000 指数增强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 208,240,927.79 元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)信会师报字[2022]第 ZA30810 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 4 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 208,253,076.92 份基金份额,其中认购资金利息折合 12,149.13 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。根据《太平中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/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。其中 A 类基金份额类别为在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,且从本类别基金资产净值中不计提销售服务费的基金份额;C 类基金份额为从本类别基金资产净值中计提销售服务费,且在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用的基金份额。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《太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股、其他国内依法发行上市的股票(含创业板、存托凭证及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称“港股通股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,港股通股票的投资比例为股票资产的 0%-50%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,

现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例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：本基金的业绩比较基准：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

本基金持有的股票投资、基金投资及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。本基金现无金融资产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。

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。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地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。

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。

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

(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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或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。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) 金融工具的后续计量

- 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企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。

对于应收账款，本基金始终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。

除应收账款外，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。

6.4.4.5 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，参考类似投资品种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。

6.4.4.6 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。

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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

6.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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成本的差额确认。本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

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。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

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。

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。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实

际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，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同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

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[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，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税一般纳税人，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。

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
	2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,461,659.92
等于：本金	4,460,725.20
加：应计利息	934.72
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	4,461,659.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	48,734,617.41	-	49,473,660.38	739,042.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	48,734,617.41	-	49,473,660.38	739,042.97

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 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无按预期信用损失一般模型计提的减值准备。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.17
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	63,559.05
其中：交易所市场	63,559.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	9,692.55
预提信息披露费	30,607.29
合计	103,860.06

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

太平中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	207,814,416.15	207,814,416.15

本期申购	11,006,938.97	11,006,938.97
本期赎回（以“-”号填列）	-171,116,146.34	-171,116,146.34
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	47,705,208.78	47,705,208.78

太平中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	438,660.77	438,660.77
本期申购	991,939.86	991,939.86
本期赎回（以“-”号填列）	-402,317.66	-402,317.66
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	1,028,282.97	1,028,282.97

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

太平中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,498,841.21	748,706.67	4,247,547.88
本期基金份额交易产生的变动数	518,715.41	370,924.95	889,640.36
其中：基金申购款	568,100.01	379,655.91	947,755.92
基金赎回款	-49,384.60	-8,730.96	-58,115.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,017,556.62	1,119,631.62	5,137,188.24

太平中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	49,271.57	-9,663.70	39,607.87
本期基金份额交易产生的变动数	36,433.53	33,786.73	70,220.26
其中：基金申购款	36,339.37	33,800.88	70,140.25

基金赎回款	94.16	-14.15	80.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,705.10	24,123.03	109,828.13

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	41,331.45	
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	225,133.82	
其他	-	
合计	266,465.27	

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年4月29日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,473,541.02	
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	3,473,541.02	

6.4.7.14.2 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 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	82,988,122.87	
减：卖出股票成本总额	79,351,414.79	
减：交易费用	163,167.06	
买卖股票差价收入	3,473,541.02	

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.16 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。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	99,481.37
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	99,481.37

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	739,042.97
股票投资	739,042.97
债券投资	-
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	739,042.97

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	641.15
合计	641.15

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	9,692.55
信息披露费	30,607.29
证券出借违约金	-
股卡开户费	400.00
合计	40,699.84

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

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

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。

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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 2022 年 4 月 29 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

本基金本报告期内没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
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	218,256.48
其中：支付销售机构的客户维护费	45,569.65

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 1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	32,738.47

注：支付基金托管行交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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		
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平中证 1000 指数增强	太平中证 1000 指数增强	合计
	A	C	
交通银行	-	136.28	136.28
太平基金	-	13.71	13.71
合计	-	149.99	149.99

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%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：日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X0.40%/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

基金管理人于本报告期内及上年度可比期间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

注：于本报告期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 2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	4,461,659.92	41,331.45

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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购入过由关联方承销的证券。

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

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末(2022 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

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减持还需根据交易所相关规定执行。

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

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

本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常投资管理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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调

和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

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

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

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

本基金本报告期末持有按长期信用评级列示的同业投资。

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 2022 年 6 月 30 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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 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时间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 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 2022 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 2022 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。

综合上述各类流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好，无重大流动性风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	4,461,659.92	-	-	-	4,461,659.92
结算备付金	462,565.78	-	-	-	462,565.78
交易性金融资产	-	-	-	49,473,660.38	49,473,660.38

应收申购款	-	-	-	199,216.72	199,216.72
应收清算款	-	-	-	569,699.80	569,699.80
资产总计	4,924,225.70	-	-	50,242,576.90	55,166,802.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	657,970.95	657,970.95
应付管理人报酬	-	-	-	35,752.66	35,752.66
应付托管费	-	-	-	5,362.92	5,362.92
应付清算款	-	-	-	383,176.89	383,176.89
应付销售服务费	-	-	-	171.00	171.00
其他负债	-	-	-	103,860.06	103,860.06
负债总计	-	-	-	1,186,294.48	1,186,294.48
利率敏感度缺口	4,924,225.70	-	-	49,056,282.42	53,980,508.12

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金以中证 1000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，力争在跟踪误差控制在目标范围内的基础上获得超越标的指数的超额收益。本基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，应当保证现金或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、存出保证金及应收申购款等。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 2022 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	49,473,660.38	91.65
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	49,473,660.38	91.65

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 (2022 年 6 月 30 日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	2,466,547.06
	沪深 300 指数下降 5%	-2,466,547.06

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 6 月 30 日
第一层次	49,473,660.38
第二层次	-
第三层次	-
合计	49,473,660.38

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 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、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 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。

§ 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	49,473,660.38	89.68
	其中：股票	49,473,660.38	89.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,924,225.70	8.93
8	其他各项资产	768,916.52	1.39
9	合计	55,166,802.60	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	82,251.00	0.15
B	采矿业	2,311,323.00	4.28
C	制造业	33,862,608.26	62.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,621,251.20	3.00
E	建筑业	2,110,560.00	3.91
F	批发和零售业	1,033,524.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	1,008,199.00	1.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,096,069.24	7.59
J	金融业	623,332.00	1.15
K	房地产业	611,628.00	1.13
L	租赁和商务服务业	668,701.00	1.24
M	科学研究和技术服务业	95,137.68	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	508,359.00	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	281,260.00	0.52
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	238,332.00	0.44
S	综合	321,125.00	0.59
	合计	49,473,660.38	91.65

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	002738	中矿资源	8,260	764,958.60	1.42
2	300438	鹏辉能源	10,700	657,515.00	1.22
3	603229	奥翔药业	16,000	608,960.00	1.13
4	600777	新潮能源	225,200	601,284.00	1.11
5	603826	坤彩科技	10,100	594,486.00	1.10
6	300672	国科微	7,200	588,672.00	1.09
7	688608	恒玄科技	4,101	564,297.60	1.05
8	688200	华峰测控	1,561	556,340.40	1.03

9	300393	中来股份	31,300	532,100.00	0.99
10	300151	昌红科技	27,600	521,640.00	0.97
11	300118	东方日升	17,700	519,141.00	0.96
12	000697	炼石航空	65,300	513,258.00	0.95
13	600742	一汽富维	55,100	511,328.00	0.95
14	002549	凯美特气	27,700	501,370.00	0.93
15	002291	星期六	25,300	499,928.00	0.93
16	688100	威胜信息	23,550	494,314.50	0.92
17	603766	隆鑫通用	106,900	492,809.00	0.91
18	600389	江山股份	8,100	491,913.00	0.91
19	002047	宝鹰股份	121,800	485,982.00	0.90
20	603398	沐邦高科	17,100	480,168.00	0.89
21	300652	雷迪克	19,600	479,612.00	0.89
22	002015	协鑫能科	27,000	478,980.00	0.89
23	000503	国新健康	52,700	473,246.00	0.88
24	300398	飞凯材料	20,700	473,202.00	0.88
25	600267	海正药业	36,900	472,689.00	0.88
26	601606	长城军工	40,700	472,527.00	0.88
27	300204	舒泰神	33,900	454,938.00	0.84
28	000016	深康佳 A	74,900	453,145.00	0.84
29	002545	东方铁塔	39,600	450,648.00	0.83
30	603881	数据港	16,600	445,710.00	0.83
31	603915	国茂股份	21,000	440,790.00	0.82
32	300428	立中集团	13,300	439,565.00	0.81
33	300523	辰安科技	15,600	435,084.00	0.81
34	688788	科思科技	9,599	433,970.79	0.80
35	000056	皇庭国际	92,900	421,766.00	0.78
36	600284	浦东建设	56,000	414,960.00	0.77
37	600166	福田汽车	146,500	414,595.00	0.77
38	300777	中简科技	8,600	414,520.00	0.77
39	000025	特力 A	17,400	409,770.00	0.76
40	300769	德方纳米	1,000	408,680.00	0.76
41	000048	京基智农	20,900	388,113.00	0.72
42	002163	海南发展	27,100	386,717.00	0.72
43	688298	东方生物	3,340	381,261.00	0.71
44	300001	特锐德	21,600	373,896.00	0.69
45	000682	东方电子	56,000	372,960.00	0.69
46	002544	普天科技	15,900	361,725.00	0.67
47	600199	金种子酒	12,700	360,045.00	0.67
48	300803	指南针	6,100	358,558.00	0.66
49	600491	龙元建设	52,200	356,004.00	0.66
50	600955	维远股份	12,200	351,848.00	0.65

51	002597	金禾实业	8,000	346,640.00	0.64
52	002192	融捷股份	2,200	338,140.00	0.63
53	002550	千红制药	58,900	337,497.00	0.63
54	600246	万通发展	36,900	335,790.00	0.62
55	000688	国城矿业	21,400	335,766.00	0.62
56	002056	横店东磁	12,600	335,412.00	0.62
57	600343	航天动力	31,500	335,160.00	0.62
58	688516	奥特维	1,249	333,420.55	0.62
59	600996	贵广网络	47,800	328,864.00	0.61
60	002505	鹏都农牧	96,600	327,474.00	0.61
61	000893	亚钾国际	9,400	323,454.00	0.60
62	600770	综艺股份	36,700	321,125.00	0.59
63	002326	永太科技	9,600	316,128.00	0.59
64	603313	梦百合	25,900	310,800.00	0.58
65	688339	亿华通	3,142	309,109.96	0.57
66	688598	金博股份	1,048	308,845.60	0.57
67	601156	东航物流	15,500	306,900.00	0.57
68	002232	启明信息	21,600	304,560.00	0.56
69	002216	三全食品	15,400	301,686.00	0.56
70	300604	长川科技	6,600	297,990.00	0.55
71	600055	万东医疗	12,200	296,826.00	0.55
72	000875	吉电股份	41,900	291,205.00	0.54
73	603128	华贸物流	28,900	289,867.00	0.54
74	600873	梅花生物	25,500	287,640.00	0.53
75	002646	天佑德酒	14,900	285,335.00	0.53
76	603306	华懋科技	8,300	281,370.00	0.52
77	003032	传智教育	19,600	281,260.00	0.52
78	300861	美畅股份	3,000	278,070.00	0.52
79	601908	京运通	34,300	275,086.00	0.51
80	688050	爱博医疗	1,210	271,282.00	0.50
81	002960	青鸟消防	9,700	265,683.00	0.49
82	600523	贵航股份	11,200	263,200.00	0.49
83	600876	洛阳玻璃	10,200	255,204.00	0.47
84	300477	合纵科技	33,100	254,870.00	0.47
85	000032	深桑达 A	16,800	251,664.00	0.47
86	300401	花园生物	14,500	251,430.00	0.47
87	600711	盛屯矿业	32,300	250,648.00	0.46
88	300775	三角防务	5,200	250,380.00	0.46
89	300829	金丹科技	7,600	246,392.00	0.46
90	600490	鹏欣资源	62,400	240,240.00	0.45
91	600378	昊华科技	6,200	238,824.00	0.44
92	002435	长江健康	48,800	238,632.00	0.44

93	000810	创维数字	14,700	238,287.00	0.44
94	300827	上能电气	4,600	235,290.00	0.44
95	600123	兰花科创	14,200	233,590.00	0.43
96	300374	中铁装配	19,100	228,436.00	0.42
97	002036	联创电子	14,766	226,805.76	0.42
98	603393	新天然气	10,500	224,280.00	0.42
99	002498	汉缆股份	52,600	223,550.00	0.41
100	002585	双星新材	12,000	217,080.00	0.40
101	688065	凯赛生物	1,890	211,302.00	0.39
102	000545	金浦钛业	51,800	210,308.00	0.39
103	600551	时代出版	18,200	205,842.00	0.38
104	300663	科蓝软件	12,800	198,144.00	0.37
105	603033	三维股份	8,740	196,999.60	0.36
106	300185	通裕重工	66,500	190,855.00	0.35
107	300319	麦捷科技	20,500	189,010.00	0.35
108	600548	深高速	19,100	182,214.00	0.34
109	003012	东鹏控股	20,800	181,792.00	0.34
110	688158	优刻得	12,426	180,549.78	0.33
111	000762	西藏矿业	3,200	178,976.00	0.33
112	002151	北斗星通	5,600	176,736.00	0.33
113	002923	润都股份	10,300	176,336.00	0.33
114	601068	中铝国际	39,800	175,518.00	0.33
115	601678	滨化股份	28,900	173,111.00	0.32
116	601952	苏垦农发	12,200	170,678.00	0.32
117	603650	彤程新材	5,200	169,416.00	0.31
118	000729	燕京啤酒	17,500	169,050.00	0.31
119	688180	君实生物	2,237	168,535.58	0.31
120	000927	中国铁物	57,700	166,176.00	0.31
121	002145	中核钛白	22,900	163,277.00	0.30
122	000918	嘉凯城	70,600	162,380.00	0.30
123	600163	中闽能源	18,800	158,860.00	0.29
124	688278	特宝生物	5,386	158,779.28	0.29
125	002481	双塔食品	18,500	157,065.00	0.29
126	002913	奥士康	4,900	155,085.00	0.29
127	600452	涪陵电力	13,320	154,645.20	0.29
128	003031	中瓷电子	2,380	153,748.00	0.28
129	601212	白银有色	55,600	153,456.00	0.28
130	300083	创世纪	12,900	148,350.00	0.27
131	688508	芯朋微	1,982	147,659.00	0.27
132	601991	大唐发电	60,300	146,529.00	0.27
133	605388	均瑶健康	8,400	144,228.00	0.27
134	688366	昊海生科	1,333	141,004.74	0.26

135	600497	驰宏锌锗	26,800	139,092.00	0.26
136	603298	杭叉集团	8,900	137,327.00	0.25
137	300767	震安科技	2,300	133,814.00	0.25
138	600458	时代新材	13,300	130,340.00	0.24
139	002176	江特电机	5,100	127,704.00	0.24
140	300052	中青宝	5,600	127,008.00	0.24
141	600621	华鑫股份	8,500	123,420.00	0.23
142	688023	安恒信息	831	122,705.46	0.23
143	300171	东富龙	3,600	122,076.00	0.23
144	000061	农产品	19,100	118,420.00	0.22
145	002214	大立科技	9,100	115,752.00	0.21
146	002945	华林证券	7,500	114,375.00	0.21
147	600459	贵研铂业	6,200	112,282.00	0.21
148	300397	天和防务	10,600	110,346.00	0.20
149	000557	西部创业	22,900	110,149.00	0.20
150	000533	顺钠股份	30,200	109,626.00	0.20
151	002488	金固股份	15,900	107,007.00	0.20
152	002461	珠江啤酒	12,600	106,848.00	0.20
153	603599	广信股份	3,680	103,592.00	0.19
154	601069	西部黄金	7,300	99,134.00	0.18
155	000534	万泽股份	7,000	94,570.00	0.18
156	600916	中国黄金	7,900	92,430.00	0.17
157	300085	银之杰	8,400	92,316.00	0.17
158	002756	永兴材料	600	91,326.00	0.17
159	600750	江中药业	6,300	90,216.00	0.17
160	300773	拉卡拉	4,700	89,582.00	0.17
161	300170	汉得信息	9,800	88,298.00	0.16
162	300598	诚迈科技	2,100	86,709.00	0.16
163	600057	厦门象屿	9,700	85,263.00	0.16
164	688133	泰坦科技	473	83,550.72	0.15
165	002141	贤丰控股	15,400	83,160.00	0.15
166	000915	华特达因	2,000	82,700.00	0.15
167	002041	登海种业	3,900	82,251.00	0.15
168	603337	杰克股份	3,800	81,624.00	0.15
169	002959	小熊电器	1,300	81,029.00	0.15
170	002773	康弘药业	5,400	80,676.00	0.15
171	600422	昆药集团	6,200	75,330.00	0.14
172	300119	瑞普生物	4,200	73,458.00	0.14
173	603105	芯能科技	6,500	72,670.00	0.13
174	603387	基蛋生物	4,920	70,159.20	0.13
175	600059	古越龙山	6,300	69,300.00	0.13
176	002374	中锐股份	16,300	66,993.00	0.12

177	002748	世龙实业	4,500	66,555.00	0.12
178	300596	利安隆	1,500	66,165.00	0.12
179	002053	云南能投	5,100	65,382.00	0.12
180	002261	拓维信息	9,900	63,459.00	0.12
181	600986	浙文互联	10,200	62,832.00	0.12
182	603565	中谷物流	3,700	58,719.00	0.11
183	600675	中华企业	18,800	57,528.00	0.11
184	600905	三峡能源	9,000	56,610.00	0.10
185	000029	深深房 A	4,700	55,930.00	0.10
186	603713	密尔克卫	400	54,680.00	0.10
187	688233	神工股份	970	54,514.00	0.10
188	000818	航锦科技	1,600	54,240.00	0.10
189	000758	中色股份	10,700	51,681.00	0.10
190	605090	九丰能源	2,500	50,675.00	0.09
191	601929	吉视传媒	23,300	47,765.00	0.09
192	600110	诺德股份	4,100	47,642.00	0.09
193	300657	弘信电子	4,000	46,480.00	0.09
194	601958	金钼股份	5,100	45,084.00	0.08
195	605168	三人行	400	43,252.00	0.08
196	000065	北方国际	4,700	39,715.00	0.07
197	300219	鸿利智汇	4,400	38,280.00	0.07
198	000552	靖远煤电	8,800	37,928.00	0.07
199	000155	川能动力	1,700	37,655.00	0.07
200	300352	北信源	7,600	35,112.00	0.07
201	300027	华谊兄弟	9,300	29,760.00	0.06
202	603567	珍宝岛	2,500	29,675.00	0.05
203	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.05
204	300373	扬杰科技	400	28,500.00	0.05
205	002839	张家港行	5,100	26,979.00	0.05
206	300709	精研科技	900	26,631.00	0.05
207	002287	奇正藏药	1,000	25,750.00	0.05
208	002419	天虹股份	3,600	25,668.00	0.05
209	688190	云路股份	330	25,657.50	0.05
210	000815	美利云	2,400	24,312.00	0.05
211	600129	太极集团	1,100	24,167.00	0.04
212	300253	卫宁健康	2,700	23,706.00	0.04
213	600903	贵州燃气	2,800	21,812.00	0.04
214	301050	雷电微力	200	20,312.00	0.04
215	688575	亚辉龙	860	17,991.20	0.03
216	688001	华兴源创	651	17,720.22	0.03
217	300702	天宇股份	600	17,046.00	0.03
218	002979	雷赛智能	800	16,336.00	0.03

219	688266	泽璟制药	418	15,002.02	0.03
220	600197	伊力特	400	12,040.00	0.02
221	600297	广汇汽车	4,600	12,006.00	0.02
222	002426	胜利精密	5,000	11,650.00	0.02
223	688222	成都先导	726	11,586.96	0.02
224	300346	南大光电	300	10,794.00	0.02
225	002434	万里扬	1,200	10,260.00	0.02
226	300768	迪普科技	500	8,075.00	0.01
227	688076	诺泰生物	232	6,004.16	0.01
228	600009	上海机场	100	5,670.00	0.01
229	000035	中国天楹	1,000	5,250.00	0.01
230	002739	万达电影	200	2,730.00	0.01
231	600391	航发科技	100	1,921.00	0.00
232	300815	玉禾田	100	1,739.00	0.00
233	002782	可立克	100	1,704.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300118	东方日升	997,605.61	1.85
2	002738	中矿资源	995,606.60	1.84
3	600777	新潮能源	988,843.00	1.83
4	002312	川发龙蟒	985,399.00	1.83
5	300803	指南针	955,725.00	1.77
6	000056	皇庭国际	822,137.16	1.52
7	002036	联创电子	776,336.54	1.44
8	002324	普利特	770,192.00	1.43
9	000810	创维数字	766,677.00	1.42
10	603033	三维股份	760,943.40	1.41
11	002201	正威新材	746,543.00	1.38
12	300861	美畅股份	740,016.00	1.37
13	600246	万通发展	718,991.00	1.33
14	002176	江特电机	707,134.00	1.31
15	002232	启明信息	675,596.00	1.25
16	600055	万东医疗	669,742.00	1.24
17	000795	英洛华	664,353.00	1.23
18	000016	深康佳 A	648,057.00	1.20
19	600284	浦东建设	639,596.00	1.18
20	601975	招商南油	631,400.00	1.17

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002312	川发龙蟒	1,094,449.00	2.03
2	002324	普利特	819,220.00	1.52
3	002201	正威新材	763,666.00	1.41
4	300803	指南针	739,033.00	1.37
5	601975	招商南油	690,730.00	1.28
6	000795	英洛华	680,414.00	1.26
7	300035	中科电气	645,119.00	1.20
8	002534	西子洁能	616,219.00	1.14
9	002036	联创电子	612,338.00	1.13
10	002426	胜利精密	578,699.00	1.07
11	002176	江特电机	568,365.00	1.05
12	600777	新潮能源	563,768.00	1.04
13	603026	石大胜华	551,573.00	1.02
14	603033	三维股份	538,023.00	1.00
15	000810	创维数字	537,740.00	1.00
16	600746	江苏索普	520,870.00	0.96
17	000829	天音控股	520,099.00	0.96
18	301069	凯盛新材	518,306.00	0.96
19	300118	东方日升	508,545.66	0.94
20	600771	广誉远	498,998.00	0.92

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	128,086,032.20
卖出股票收入（成交）总额	82,988,122.87

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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 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、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，山东新潮能源股份有限公司在本报告期内被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。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	-
2	应收清算款	569,699.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	199,216.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	768,916.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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 (%)
太平中证 1000 指数增强 A	264	180,701.55	25,987,603.50	54.4754	21,717,605.28	45.5246
太平中证 1000 指数增强 C	59	17,428.52	0.00	0.0000	1,028,282.97	100.0000
合计	313	155,698.06	25,987,603.50	53.3260	22,745,888.25	46.6740

注：在同一基金账号同时持有 A 类和 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	太平中证 1000 指数增强 A	2,924,015.42	6.1293
	太平中证 1000 指数增强 C	57,491.63	5.5910
	合计	2,981,507.05	6.1180

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	太平中证 1000 指数增强 A	10~50
	太平中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有	太平中证 1000 指数增强 A	>100

本开放式基金	太平中证 1000 指数增强 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	太平中证 1000 指数增强 A	太平中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2022 年 4 月 29 日) 基金份额总额	207,814,416.15	438,660.77
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	11,006,938.97	991,939.86
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	171,116,146.34	402,317.66
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	47,705,208.78	1,028,282.97

§ 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

(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。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

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发生改变。

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 (%)	
天风证券	2	211,074,155.07	100.00	63,559.05	100.00	-

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

本基金本报告期内新增租用天风证券 2 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 (%)
天风证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊、基金管理人网站	2022 年 04 月 30 日
2	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务的公告	指定报刊、基金管理人网站	2022 年 05 月 13 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	20220429-20220530	50,000,000.00	-	50,000,000.00	0.00	0.0000
机构	2	20220429-20220530	50,000,000.00	-	50,000,000.00	0.00	0.0000
机构	3	20220429-20220530	49,999,000.00	-	49,999,000.00	0.00	0.0000
	4	20220531-20220630	13,782,582.80	-	-	13,782,582.80	28.2815
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：报告期末同一投资者通过多个基金账户持有本基金的合并计算。

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、《太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《太平中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平中证 1000 指数增强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

2022 年 8 月 31 日