

太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2022 年 04 月 29 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	错误!未定义书签。
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
§ 10 开放式基金份额变动	63
§ 11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	65
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 13 备查文件目录	66
13.1 备查文件目录	66
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	66

§ 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	69,892,374.64 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	61,874,892.23 份	8,017,482.41 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 7 楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 4 月 29 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 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	2,207,348.90	-273,864.55
本期利润	-20,459.13	-540,197.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0003	-0.2079
本期加权平均净值利润率	-0.03%	-19.74%
本期基金份额净值增长率	0.24%	-0.04%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	
期末可供分配利润	148,330.28	-3,439.34
期末可供分配基金份额利润	0.0024	-0.0004
期末基金资产	62,023,222.51	8,014,043.07

净值		
期末基金份额净值	1.0024	0.9996
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	
基金份额累计净值增长率	0.24%	-0.04%

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

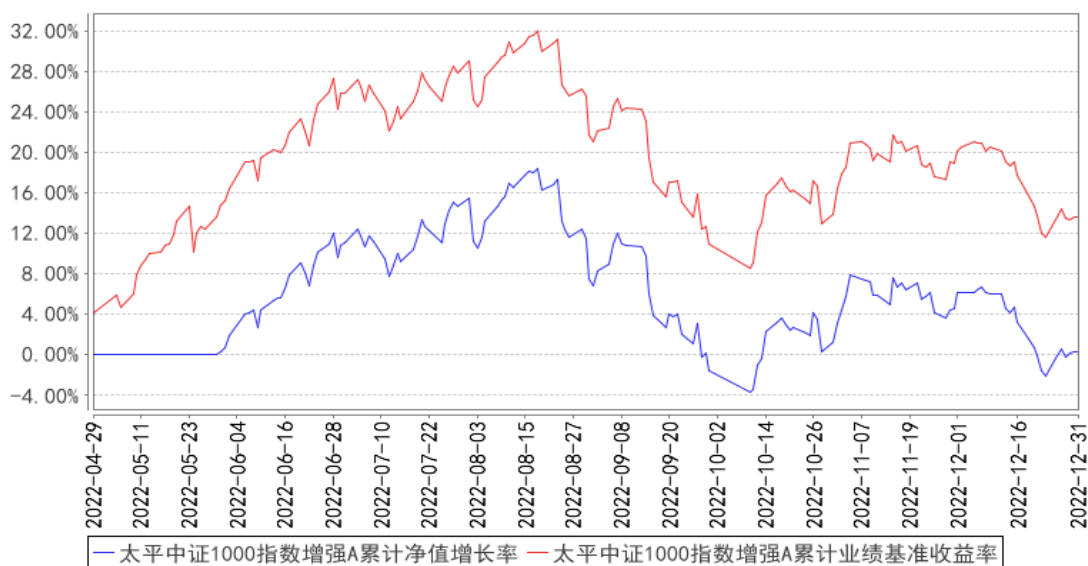
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.88%	1.17%	2.46%	1.14%	-0.58%	0.03%
过去六个月	-9.51%	1.28%	-9.67%	1.21%	0.16%	0.07%
自基金合同生效起至今	0.24%	1.20%	13.67%	1.28%	-13.43%	-0.08%

太平中证 1000 指数增强 C

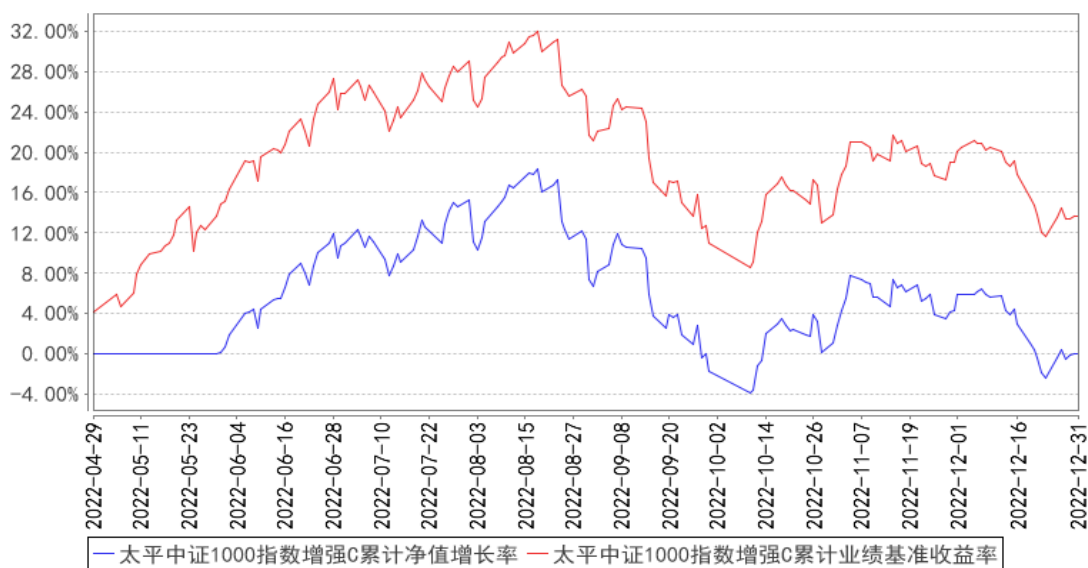
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.77%	1.17%	2.46%	1.14%	-0.69%	0.03%
过去六个月	-9.69%	1.28%	-9.67%	1.21%	-0.02%	0.07%
自基金合同生效起至今	-0.04%	1.20%	13.67%	1.28%	-13.71%	-0.08%

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



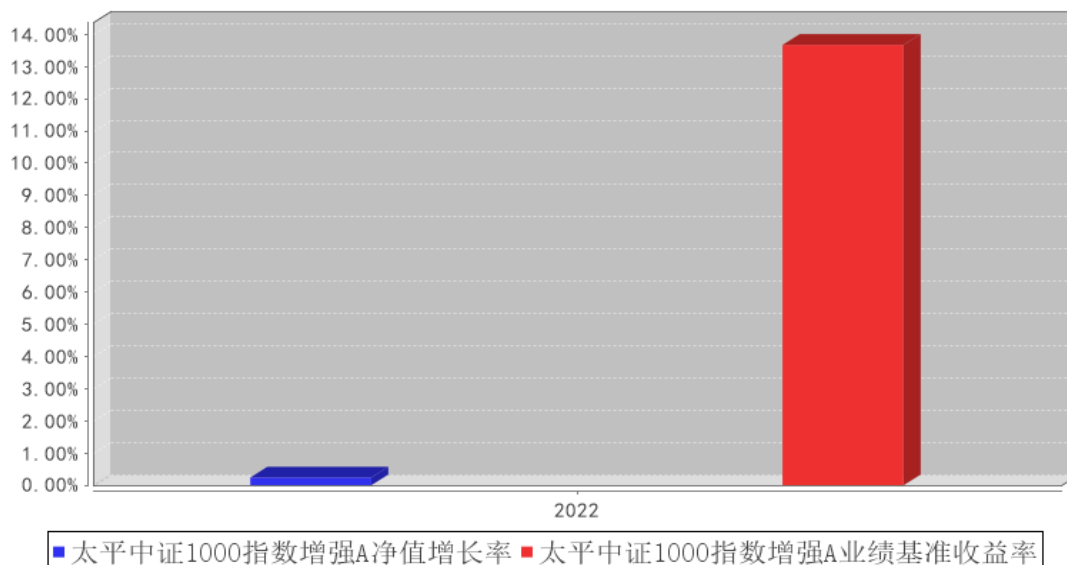
太平中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



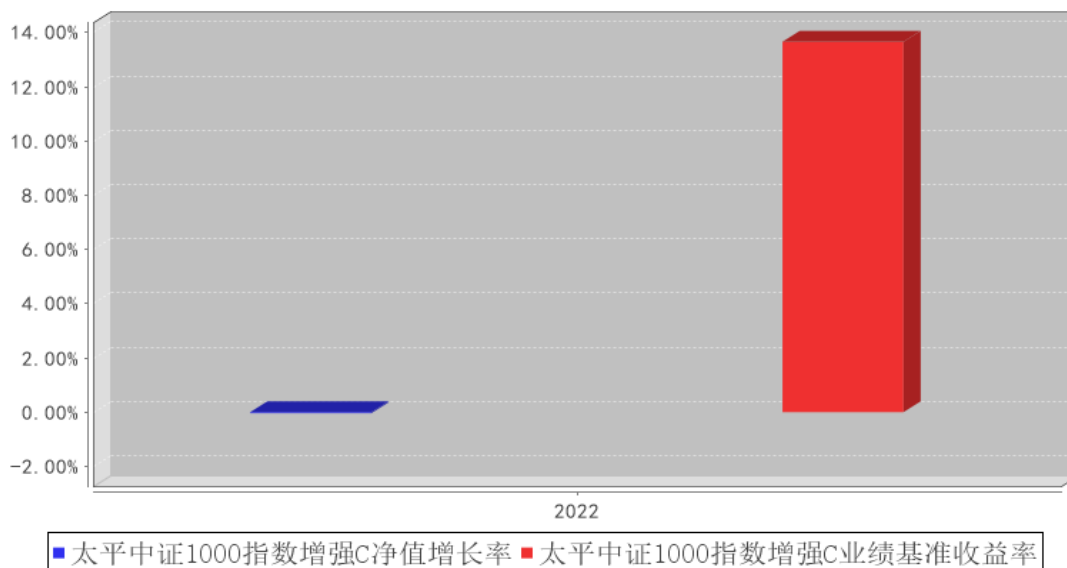
注：图示日期为 2022 年 4 月 29 日至 2022 年 12 月 31 日。本基金基金合同生效日为 2022 年 4 月 29 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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

太平中证1000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



太平中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2022 年 4 月 29 日，至本报告期末未满 5 年。

2、合同生效按当年实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立，2016 年 8 月 22 日更名为太平基金管理有限公司。截至本报告期末，公司注册资本为人民币 6.5 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 56.31%，太平人寿保险有限公司出资占注册资本 38.46%，安石投资管理有限公司出资占注册资本 5.23%。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张子权	本基金的基金经理、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	2022 年 4 月 29 日	-	6 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 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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，本基金存在 6 个月建仓期。在建仓期初，

由于股票仓位与基准存在较大差异，本基金前期业绩大幅低于基准。本基金于 6 月初基本完成股票建仓。自 8 月份始，受到市场波动及市场流动性大幅降低的影响，产品净值以及超额收益均发生了一定的回撤。自三季度末开始，本基金加强了对于基准的跟踪误差控制，有效控制了超额收益回撤的继续扩大。整体来看，产品自 6 月完成建仓起，有效控制了跟踪误差，且获取了一定的超额收益。

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 的份额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准收益率为 13.67%。太平中证 1000 指数增强 C 的份额净值增长率为-0.04%，同期业绩比较基准收益率为 13.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年政策暖风将继续推动经济缓慢复苏，但需要关注收入对消费的制约、房地产政策的有效性，以及外需回落对出口和制造业带来的间接影响。货币政策继续强调精准，对于通胀关注度提升，预计降准和存款利率下降将驱动 LPR 下调，结构性货币政策将持续发力。行业上党的二十大为未来我们国家经济建设和产业发展指明了方向。围绕“安全”、“科技”、“医疗医药”、“创新”、“制造”等关键词，2023 年市场或将强化对于“硬”科技的关注，包括自主可控、高端制造、新能源、医疗医药、军工等领域在资金的持续关注下，估值水平或有进一步提升。大小盘风格上，我们从估值、盈利、成长三个维度观察，小盘股依旧处于估值相对便宜，盈利水平相对较好，成长性相对较强的历史区间，2023 年我们看好小盘股具备较好的投资价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利

益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关约定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2022 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 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2022 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2302224 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的太平中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	该基金管理人太平基金管理有限公司（以下简称“该基金管理

	<p>人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2022 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审</p>

	<p>计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张楠	李晨宇
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼	
审计报告日期	2023 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	3,258,250.14
结算备付金		1,165,184.49
存出保证金		63,492.86
交易性金融资产	7.4.7.2	66,551,061.45
其中：股票投资		65,543,010.33
基金投资		-
债券投资		1,008,051.12
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		847,834.83
应收股利		-

应收申购款		99,315.19
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		71,985,138.96
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		768,643.90
应付清算款		743,559.69
应付赎回款		71,839.07
应付管理人报酬		60,213.31
应付托管费		9,031.98
应付销售服务费		2,448.04
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	7.4.7.9	292,137.39
负债合计		1,947,873.38
净资产:		
实收基金	7.4.7.10	69,892,374.64
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	144,890.94
净资产合计		70,037,265.58
负债和净资产总计		71,985,138.96

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，太平中证 1000 指数增强 A 份额净值 1.0024 元，基金份额总额 61,874,892.23 份，太平中证 1000 指数增强 C 份额净值 0.9996 元，基金份额总额 8,017,482.41 份，总份额合计 69,892,374.64 份。

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。

7.2 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 12 月 31 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12月31 日

一、营业总收入		189,513.00
1. 利息收入		288,622.98
其中：存款利息收入	7.4.7.13	288,622.98
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）		2,386,648.64
其中：股票投资收益	7.4.7.14	2,185,144.29
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	12,596.31
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	188,908.04
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-2,494,141.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	8,382.52
减：二、营业总支出		750,169.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	512,778.89
2. 托管费	7.4.10.2.2	76,916.80
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	7,134.31
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		4,939.79
其中：卖出回购金融资产支出		4,939.79
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	148,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-560,656.79
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-560,656.79
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-560,656.79

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。

7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
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)	-138,360,702.28	-	144,890.94	-138,215,811.34
(一)、综合收益总额	-	-	-560,656.79	-560,656.79
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-138,360,702.28	-	705,547.73	-137,655,154.55
其中：1. 基金申购款	62,044,455.64	-	3,475,666.96	65,520,122.60
2	-200,405,157.92	-	-2,770,119.23	-203,175,277.15

. 基金赎回款				
(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)	69,892,374.64	-	144,890.94	70,037,265.58

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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

范宇

邓先虎

王瑞瑾

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

太平中证 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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资和债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

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

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

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

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

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

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

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

-以摊余成本计量的金融资产

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

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术

中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

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

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 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。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，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。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。对于在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》,在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)、财税[2005]103号文《关

于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

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

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	3,258,250.14
等于：本金	3,257,490.87
加：应计利息	759.27
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	3,258,250.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	68,032,703.47	-	65,543,010.33	-2,489,693.14	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,006,708.00	5,791.12	1,008,051.12	-4,448.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,006,708.00	5,791.12	1,008,051.12	-4,448.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	69,039,411.47	5,791.12	66,551,061.45	-2,494,141.14	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金于本报告期末未持有任何期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金于本报告期末未持有任何黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金于本报告期末未计提减值准备。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金于本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

7.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有任何其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	42.53
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	144,094.86
其中：交易所市场	144,094.86
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	28,000.00
预提信息披露费	120,000.00
合计	292,137.39

7.4.7.10 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 12 月 31 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	51,433,582.81	51,433,582.81
本期赎回（以“-”号填列）	-197,373,106.73	-197,373,106.73

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	61,874,892.23	61,874,892.23

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 12 月 31 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	10,610,872.83	10,610,872.83
本期赎回（以“-”号填列）	-3,032,051.19	-3,032,051.19
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	8,017,482.41	8,017,482.41

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期间未发生其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

太平中证 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	2,207,348.90	-2,227,808.03	-20,459.13
本期基金份额交易产生的变动数	-114,701.37	283,490.78	168,789.41
其中：基金申购款	2,892,064.92	-78,900.38	2,813,164.54
基金赎回款	-3,006,766.29	362,391.16	-2,644,375.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,092,647.53	-1,944,317.25	148,330.28

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	-273,864.55	-266,333.11	-540,197.66
本期基金份额交易产生的变动数	521,877.11	14,881.21	536,758.32
其中：基金申购款	723,481.58	-60,979.16	662,502.42
基金赎回款	-201,604.47	75,860.37	-125,744.10
本期已分配利润	-	-	-

本期末	248,012.56	-251,451.90	-3,439.34
-----	------------	-------------	-----------

7.4.7.13 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12月31日	
活期存款利息收入	55,889.07	
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	232,450.90	
其他	283.01	
合计	288,622.98	

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年4月29日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,185,144.29	
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	2,185,144.29	

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年4月29日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
卖出股票成交总额	777,227,103.58	
减：卖出股票成本总额	773,826,840.66	
减：交易费用	1,215,118.63	
买卖股票差价收入	2,185,144.29	

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年4月29日（基金合同生效日）至2022年12月31日	

债券投资收益——利息收入	6,712.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,883.32
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,596.31

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月29日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	844,394.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	831,944.00
减：应计利息总额	6,565.36
减：交易费用	1.60
买卖债券差价收入	5,883.32

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金在本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	188,908.04
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	188,908.04

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-2,494,141.14
股票投资	-2,489,693.14
债券投资	-4,448.00
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	-2,494,141.14

7.4.7.21 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 12 月 31 日
基金赎回费收入	8,382.52
合计	8,382.52

7.4.7.22 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	28,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	148,400.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
太平基金管理有限公司（“太平基金”）	基金管理人、基金销售机构、登记机构
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
太平资产管理有限公司（“太平资管”）	基金管理人的股东
太平人寿保险有限公司（“太平人寿”）	基金管理人的股东
安石投资管理有限公司（“安石投资”）	基金管理人的股东

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内没有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	512,778.89
其中：支付销售机构的客户维护费	134,890.03

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 1.00%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×1.00%/当年天数

7.4.10.2.2 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 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	76,916.80

注：支付基金托管人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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期

名称	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	太平中证 1000 指数增 强 A	太平中证 1000 指数增 强 C	合计
交通银行	-	191.58	191.58
太平基金	-	552.12	552.12
合计	-	743.70	743.70

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：太平中证 1000 指数增强 C 日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未持有过本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

太平中证 1000 指数增强 A

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
太平人寿保险有限公司	29,336,006.26	47.4118

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2022 年 4 月 29 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,258,250.14	55,889.07

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2022 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,161,756.97 元。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600459	贵研铂业	2022 年 12 月 22 日	13 天	配股未流通	10.91	15.74	10,470	114,227.70	164,797.80	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直	2022	筹划重	46.41	2023	51.05	3,000	140,883.00	139,230.00	-

	股份	年 12 月 26 日	大资产 重组		年 1 月 10 日					
--	----	-------------------	-----------	--	------------------	--	--	--	--	--

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2022 年 12 月 31 日，本基金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 768,643.90 元，于 2023 年 1 月 18 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属股票型基金，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。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。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以上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与风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	201,371.23
合计	201,371.23

注：未评级债券为国债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	806,679.89

合计	806,679.89
----	------------

注：未评级债券为国债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公

司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金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。下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,258,250.14	-	-	-	3,258,250.14
结算备付金	1,165,184.49	-	-	-	1,165,184.49
存出保证金	63,492.86	-	-	-	63,492.86
交易性金融资产	1,008,051.12	-	-	65,543,010.33	66,551,061.45
应收清算款	-	-	-	847,834.83	847,834.83
应收申购款	-	-	-	99,315.19	99,315.19
资产总计	5,494,978.61	-	-	66,490,160.35	71,985,138.96
负债					
卖出回购金融资产款	768,643.90	-	-	-	768,643.90
应付清算款	-	-	-	743,559.69	743,559.69
应付赎回款	-	-	-	71,839.07	71,839.07
应付管理人报酬	-	-	-	60,213.31	60,213.31
应付托管费	-	-	-	9,031.98	9,031.98
应付销售服务费	-	-	-	2,448.04	2,448.04
其他负债	-	-	-	292,137.39	292,137.39
负债总计	768,643.90	-	-	1,179,229.48	1,947,873.38
利率敏感度缺口	4,726,334.71	-	-	65,310,930.87	70,037,265.58

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.44%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	65,543,010.33	93.58
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	65,543,010.33	93.58

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2022 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	2,147,926.24
	沪深 300 指数下降 5%	-2,147,926.24

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	65,238,982.53
第二层次	1,312,078.92
第三层次	-
合计	66,551,061.45

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金在本报告期内未持有第三层次公允价值资产。

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

本基金在本报告期末未持有第三层次公允价值资产。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	65,543,010.33	91.05
	其中：股票	65,543,010.33	91.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,008,051.12	1.40
	其中：债券	1,008,051.12	1.40
	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	4,423,434.63	6.14
8	其他各项资产	1,010,642.88	1.40
9	合计	71,985,138.96	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资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	1,077,234.00	1.54
B	采矿业	1,570,955.00	2.24
C	制造业	39,210,710.29	55.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,708,723.00	2.44
E	建筑业	655,464.00	0.94
F	批发和零售业	1,000,831.00	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	1,473,986.00	2.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,698,966.03	8.14
J	金融业	1,258,482.00	1.80
K	房地产业	782,113.00	1.12
L	租赁和商务服务业	440,906.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	906,712.00	1.29
N	水利、环境和公共	210,136.00	0.30

	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	278,616.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	56,273,834.32	80.35

8.2.2 报告期末积极投资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	2,369.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,191,929.41	8.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	362,625.00	0.52
F	批发和零售业	311,863.00	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	266.80	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	387,099.92	0.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	124,160.00	0.18
L	租赁和商务服务业	462,272.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	982,294.88	1.40
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	444,296.00	0.63
S	综合	-	-
	合计	9,269,176.01	13.23

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	300593	新雷能	18,200	773,136.00	1.10
2	300775	三角防务	20,000	760,000.00	1.09
3	300855	图南股份	15,600	729,924.00	1.04
4	000712	锦龙股份	55,900	723,346.00	1.03
5	600459	贵研铂业	45,370	714,123.80	1.02
6	300674	宇信科技	49,300	692,665.00	0.99
7	300910	瑞丰新材	5,300	653,543.00	0.93
8	300596	利安隆	11,700	638,469.00	0.91
9	600685	中船防务	30,200	626,952.00	0.90
10	002518	科士达	10,700	616,320.00	0.88
11	300487	蓝晓科技	8,800	612,392.00	0.87
12	300525	博思软件	30,700	607,860.00	0.87
13	002317	众生药业	22,500	607,275.00	0.87
14	002463	沪电股份	50,500	600,950.00	0.86
15	002436	兴森科技	61,100	591,448.00	0.84
16	002626	金达威	28,400	588,448.00	0.84
17	300666	江丰电子	8,500	588,200.00	0.84
18	603599	广信股份	19,700	579,180.00	0.83
19	688598	金博股份	2,628	576,793.44	0.82
20	300203	聚光科技	17,000	576,300.00	0.82
21	300502	新易盛	24,000	570,000.00	0.81
22	000735	罗牛山	80,600	569,842.00	0.81
23	002291	遥望科技	42,900	557,700.00	0.80
24	688518	联赢激光	18,879	551,455.59	0.79
25	600363	联创光电	23,100	550,011.00	0.79
26	600481	双良节能	42,400	548,656.00	0.78
27	600151	航天机电	67,200	547,680.00	0.78
28	300627	华测导航	19,700	547,660.00	0.78
29	300567	精测电子	10,900	547,180.00	0.78
30	000682	东方电子	68,015	546,840.60	0.78
31	603505	金石资源	13,800	546,756.00	0.78
32	002837	英维克	16,400	546,284.00	0.78
33	002085	万丰奥威	91,600	545,020.00	0.78
34	688556	高测股份	7,243	543,369.86	0.78
35	002698	博实股份	38,710	542,327.10	0.77
36	600305	恒顺醋业	43,900	540,409.00	0.77
37	002015	协鑫能科	41,100	539,232.00	0.77
38	603733	仙鹤股份	17,600	536,272.00	0.77
39	002222	福晶科技	33,300	526,806.00	0.75

40	688408	中信博	5,343	525,751.20	0.75
41	603098	森特股份	18,600	524,892.00	0.75
42	603060	国检集团	40,500	522,450.00	0.75
43	000982	中银绒业	292,400	520,472.00	0.74
44	002550	千红制药	82,600	517,076.00	0.74
45	688298	东方生物	6,674	514,632.14	0.73
46	603906	龙蟠科技	22,223	514,462.45	0.73
47	000688	国城矿业	31,700	513,857.00	0.73
48	002437	誉衡药业	202,200	513,588.00	0.73
49	000727	冠捷科技	260,400	512,988.00	0.73
50	300039	上海凯宝	63,400	511,004.00	0.73
51	300702	天宇股份	20,000	510,400.00	0.73
52	000426	兴业矿业	83,800	510,342.00	0.73
53	300369	绿盟科技	49,900	509,479.00	0.73
54	002041	登海种业	25,600	507,392.00	0.72
55	000913	钱江摩托	27,400	506,352.00	0.72
56	000652	泰达股份	125,300	504,959.00	0.72
57	688037	芯源微	3,222	504,243.00	0.72
58	001270	铖昌科技	4,100	500,200.00	0.71
59	000555	神州信息	46,300	498,651.00	0.71
60	301015	百洋医药	20,800	495,872.00	0.71
61	300470	中密控股	12,700	494,157.00	0.71
62	002232	启明信息	39,200	492,744.00	0.70
63	000966	长源电力	105,900	490,317.00	0.70
64	600098	广州发展	88,300	490,065.00	0.70
65	002946	新乳业	37,000	489,510.00	0.70
66	002929	润建股份	12,300	482,898.00	0.69
67	002456	欧菲光	100,600	473,826.00	0.68
68	600496	精工钢构	119,700	472,815.00	0.68
69	603298	杭叉集团	28,100	472,361.00	0.67
70	688696	极米科技	2,830	470,346.00	0.67
71	601519	大智慧	79,500	457,125.00	0.65
72	603118	共进股份	57,000	453,150.00	0.65
73	300438	鹏辉能源	5,800	452,342.00	0.65
74	600548	深高速	49,300	442,714.00	0.63
75	300633	开立医疗	7,900	433,157.00	0.62
76	000061	农产品	75,700	431,490.00	0.62
77	688127	蓝特光学	26,695	425,251.35	0.61
78	003031	中瓷电子	4,400	423,720.00	0.60
79	002906	华阳集团	12,700	421,894.00	0.60
80	601678	滨化股份	81,600	419,424.00	0.60
81	000582	北部湾港	54,100	399,799.00	0.57
82	688198	佰仁医疗	3,009	388,161.00	0.55

83	002967	广电计量	22,900	384,262.00	0.55
84	300348	长亮科技	36,200	368,516.00	0.53
85	603348	文灿股份	6,400	368,448.00	0.53
86	000657	中钨高新	22,800	361,152.00	0.52
87	600565	迪马股份	164,900	356,184.00	0.51
88	688158	优刻得	28,007	350,367.57	0.50
89	600761	安徽合力	26,560	349,264.00	0.50
90	688017	绿的谐波	3,604	348,795.12	0.50
91	000811	冰轮环境	31,222	346,564.20	0.49
92	002038	双鹭药业	40,400	332,088.00	0.47
93	601212	白银有色	126,300	328,380.00	0.47
94	300497	富祥药业	24,500	323,400.00	0.46
95	000566	海南海药	73,900	315,553.00	0.45
96	600575	淮河能源	127,100	306,311.00	0.44
97	002918	蒙娜丽莎	17,000	305,660.00	0.44
98	000036	华联控股	74,900	303,345.00	0.43
99	301039	中集车辆	36,700	292,499.00	0.42
100	300352	北信源	70,300	286,824.00	0.41
101	002481	双塔食品	44,900	281,074.00	0.40
102	603103	横店影视	18,400	271,216.00	0.39
103	300185	通裕重工	112,900	270,960.00	0.39
104	300395	菲利华	4,900	269,500.00	0.38
105	688366	昊海生科	2,488	242,679.52	0.35
106	605008	长鸿高科	14,500	236,495.00	0.34
107	300777	中简科技	4,700	231,005.00	0.33
108	600720	祁连山	22,500	223,425.00	0.32
109	002004	华邦健康	40,800	208,080.00	0.30
110	603766	隆鑫通用	42,800	208,008.00	0.30
111	300451	创业慧康	26,100	206,451.00	0.29
112	300188	美亚柏科	14,900	191,614.00	0.27
113	002911	佛燃能源	15,600	187,044.00	0.27
114	601929	吉视传媒	96,100	186,434.00	0.27
115	600963	岳阳林纸	32,500	177,125.00	0.25
116	600063	皖维高新	30,200	176,670.00	0.25
117	002182	云海金属	8,000	168,800.00	0.24
118	000088	盐田港	30,200	153,114.00	0.22
119	002239	奥特佳	59,200	148,000.00	0.21
120	688023	安恒信息	721	142,758.00	0.20
121	300055	万邦达	16,200	130,572.00	0.19
122	600675	中华企业	39,800	122,584.00	0.18
123	603588	高能环境	11,600	114,144.00	0.16
124	002258	利尔化学	6,000	107,760.00	0.15
125	600872	中炬高新	2,900	106,923.00	0.15

126	603826	坤彩科技	2,000	104,820.00	0.15
127	688516	奥特维	518	104,118.00	0.15
128	002636	金安国纪	12,700	98,933.00	0.14
129	002079	苏州固锔	7,200	96,408.00	0.14
130	600323	瀚蓝环境	5,200	95,992.00	0.14
131	600179	安通控股	26,900	88,501.00	0.13
132	600955	维远股份	3,800	78,926.00	0.11
133	002145	中核钛白	11,900	73,304.00	0.10
134	300068	南都电源	3,400	72,420.00	0.10
135	002558	巨人网络	8,886	70,732.56	0.10
136	002807	江阴银行	17,100	67,887.00	0.10
137	600696	岩石股份	2,700	67,176.00	0.10
138	000935	四川双马	3,000	63,000.00	0.09
139	000676	智度股份	9,700	51,313.00	0.07
140	600662	外服控股	7,100	42,387.00	0.06
141	000557	西部创业	8,400	41,160.00	0.06
142	000860	顺鑫农业	1,300	38,766.00	0.06
143	000801	四川九洲	5,800	37,816.00	0.05
144	002293	罗莱生活	3,300	37,026.00	0.05
145	688798	艾为电子	284	27,130.52	0.04
146	300080	易成新能	5,700	26,562.00	0.04
147	600612	老凤祥	600	25,680.00	0.04
148	002428	云南锗业	2,500	23,300.00	0.03
149	002318	久立特材	900	14,976.00	0.02
150	600073	上海梅林	1,600	12,720.00	0.02
151	002400	省广集团	2,200	9,416.00	0.01
152	300770	新媒股份	200	7,532.00	0.01
153	601921	浙版传媒	1,000	7,400.00	0.01
154	601375	中原证券	2,000	7,280.00	0.01
155	000627	天茂集团	900	2,844.00	0.00
156	300579	数字认证	110	2,654.30	0.00
157	300768	迪普科技	200	2,632.00	0.00
158	605090	九丰能源	100	2,065.00	0.00
159	688578	艾力斯	100	1,968.00	0.00
160	002217	合力泰	700	1,785.00	0.00

8.3.2 期末积极投资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	688248	南网科技	9,300	531,030.00	0.76
2	002269	美邦服饰	235,100	474,902.00	0.68
3	600732	爱旭股份	12,400	468,968.00	0.67
4	300260	新莱应材	6,900	462,990.00	0.66
5	002210	飞马国际	198,400	462,272.00	0.66

6	002868	绿康生化	8,600	456,574.00	0.65
7	600613	神奇制药	55,200	454,296.00	0.65
8	600200	江苏吴中	59,100	452,115.00	0.65
9	688105	诺唯赞	8,492	451,264.88	0.64
10	688326	经纬恒润	3,017	450,438.10	0.64
11	002424	贵州百灵	54,900	447,984.00	0.64
12	300413	芒果超媒	14,800	444,296.00	0.63
13	000756	新华制药	14,100	424,410.00	0.61
14	688076	诺泰生物	16,954	388,924.76	0.56
15	688206	概伦电子	13,766	387,099.92	0.55
16	600595	中孚实业	128,900	386,700.00	0.55
17	600853	龙建股份	96,700	362,625.00	0.52
18	600056	中国医药	18,100	311,863.00	0.45
19	002531	天顺风能	15,500	234,515.00	0.33
20	002501	利源精制	117,700	218,922.00	0.31
21	603880	南卫股份	28,700	177,940.00	0.25
22	300351	永贵电器	10,300	159,341.00	0.23
23	600038	中直股份	3,000	139,230.00	0.20
24	000970	中科三环	9,700	132,308.00	0.19
25	000886	海南高速	25,600	124,160.00	0.18
26	688766	普冉股份	809	122,927.55	0.18
27	603703	盛洋科技	4,700	66,928.00	0.10
28	002644	佛慈制药	3,400	31,722.00	0.05
29	600521	华海药业	900	19,674.00	0.03
30	600213	亚星客车	1,200	14,556.00	0.02
31	002299	圣农发展	100	2,369.00	0.00
32	300583	赛托生物	100	2,279.00	0.00
33	300415	伊之密	100	1,771.00	0.00
34	000836	富通信息	300	813.00	0.00
35	300056	中创环保	100	701.00	0.00
36	600033	福建高速	92	266.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	300438	鹏辉能源	3,576,457.00	5.11
2	002015	协鑫能科	3,419,072.00	4.88
3	300666	江丰电子	3,404,868.00	4.86
4	600246	万通发展	3,063,662.00	4.37
5	300634	彩讯股份	2,976,454.00	4.25
6	002865	钧达股份	2,815,735.00	4.02
7	603306	华懋科技	2,802,792.00	4.00

8	002232	启明信息	2,786,698.00	3.98
9	688598	金博股份	2,721,541.61	3.89
10	600641	万业企业	2,676,756.00	3.82
11	601890	亚星锚链	2,622,107.00	3.74
12	600685	中船防务	2,605,049.00	3.72
13	300775	三角防务	2,580,835.00	3.68
14	300777	中简科技	2,532,509.00	3.62
15	688617	惠泰医疗	2,528,462.43	3.61
16	002868	绿康生化	2,512,740.00	3.59
17	300260	新莱应材	2,469,942.00	3.53
18	688063	派能科技	2,456,165.47	3.51
19	603063	禾望电气	2,395,717.00	3.42
20	002518	科士达	2,345,124.00	3.35
21	002335	科华数据	2,327,897.04	3.32
22	300776	帝尔激光	2,327,540.90	3.32
23	603595	东尼电子	2,308,643.00	3.30
24	600478	科力远	2,300,922.00	3.29
25	300118	东方日升	2,298,973.61	3.28
26	003031	中瓷电子	2,260,673.00	3.23
27	002866	传艺科技	2,182,295.00	3.12
28	002773	康弘药业	2,154,056.61	3.08
29	300204	舒泰神	2,131,871.00	3.04
30	300393	中来股份	2,125,688.00	3.04
31	002549	凯美特气	2,114,193.00	3.02
32	603229	奥翔药业	2,100,227.00	3.00
33	300702	天宇股份	2,085,764.00	2.98
34	688023	安恒信息	2,061,108.81	2.94
35	600363	联创光电	2,047,445.00	2.92
36	603398	沐邦高科	2,010,233.00	2.87
37	000688	国城矿业	1,979,270.00	2.83
38	000155	川能动力	1,978,111.00	2.82
39	300672	国科微	1,972,735.00	2.82
40	688516	奥特维	1,961,987.16	2.80
41	688408	中信博	1,947,752.93	2.78
42	300395	菲利华	1,940,824.00	2.77
43	603766	隆鑫通用	1,923,597.00	2.75
44	000546	金圆股份	1,891,913.00	2.70
45	000810	创维数字	1,887,264.00	2.69
46	300596	利安隆	1,882,305.00	2.69
47	688017	绿的谐波	1,880,787.16	2.69
48	600877	声光电科	1,870,315.00	2.67
49	600151	航天机电	1,862,467.00	2.66
50	002388	新亚制程	1,859,671.00	2.66

51	300348	长亮科技	1,849,335.00	2.64
52	002435	长江健康	1,847,990.00	2.64
53	300861	美畅股份	1,842,549.00	2.63
54	300208	青岛中程	1,816,560.00	2.59
55	600335	国机汽车	1,812,739.00	2.59
56	002312	川发龙蟒	1,802,884.00	2.57
57	002747	埃斯顿	1,783,564.00	2.55
58	605123	派克新材	1,767,425.00	2.52
59	000819	岳阳兴长	1,757,587.00	2.51
60	600172	黄河旋风	1,751,458.00	2.50
61	600732	爱旭股份	1,750,839.00	2.50
62	300567	精测电子	1,749,014.00	2.50
63	000762	西藏矿业	1,747,174.21	2.49
64	002698	博实股份	1,737,759.70	2.48
65	002201	正威新材	1,736,669.00	2.48
66	601882	海天精工	1,730,800.00	2.47
67	002906	华阳集团	1,729,832.00	2.47
68	002389	航天彩虹	1,723,042.00	2.46
69	300125	聆达股份	1,714,499.00	2.45
70	603212	赛伍技术	1,700,670.00	2.43
71	603505	金石资源	1,699,431.20	2.43
72	600063	皖维高新	1,695,982.00	2.42
73	000025	特力 A	1,690,704.00	2.41
74	603298	杭叉集团	1,683,947.00	2.40
75	300674	宇信科技	1,675,719.00	2.39
76	002192	融捷股份	1,664,115.00	2.38
77	603990	麦迪科技	1,660,685.00	2.37
78	000970	中科三环	1,654,620.00	2.36
79	002190	成飞集成	1,652,803.00	2.36
80	600992	贵绳股份	1,648,933.00	2.35
81	300151	昌红科技	1,637,983.00	2.34
82	002785	万里石	1,637,833.00	2.34
83	600055	万东医疗	1,633,641.00	2.33
84	600184	光电股份	1,625,160.00	2.32
85	600761	安徽合力	1,594,241.40	2.28
86	603033	三维股份	1,594,023.40	2.28
87	300487	蓝晓科技	1,588,942.00	2.27
88	300726	宏达电子	1,581,686.00	2.26
89	605008	长鸿高科	1,580,736.00	2.26
90	600836	上海易连	1,578,190.98	2.25
91	300346	南大光电	1,570,685.90	2.24
92	688169	石头科技	1,554,402.65	2.22
93	002498	汉缆股份	1,551,483.00	2.22

94	002218	拓日新能	1,546,862.00	2.21
95	000555	神州信息	1,532,506.00	2.19
96	002667	鞍重股份	1,528,279.00	2.18
97	000034	神州数码	1,526,759.65	2.18
98	300365	恒华科技	1,522,729.00	2.17
99	300525	博思软件	1,522,309.00	2.17
100	688202	美迪西	1,510,946.70	2.16
101	300319	麦捷科技	1,506,327.00	2.15
102	300206	理邦仪器	1,488,522.00	2.13
103	600557	康缘药业	1,479,482.00	2.11
104	002121	科陆电子	1,477,994.00	2.11
105	601369	陕鼓动力	1,473,883.00	2.10
106	600916	中国黄金	1,472,490.00	2.10
107	300379	东方通	1,470,987.00	2.10
108	300101	振芯科技	1,470,252.00	2.10
109	002967	广电计量	1,469,089.00	2.10
110	300633	开立医疗	1,460,481.00	2.09
111	600996	贵广网络	1,446,334.00	2.07
112	002436	兴森科技	1,433,121.00	2.05
113	603596	伯特利	1,419,512.00	2.03
114	002707	众信旅游	1,412,105.00	2.02
115	300294	博雅生物	1,405,699.00	2.01
116	688083	中望软件	1,402,353.55	2.00
117	002585	双星新材	1,401,529.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	300438	鹏辉能源	3,322,436.00	4.74
2	600246	万通发展	3,095,885.00	4.42
3	002015	协鑫能科	2,978,376.00	4.25
4	002865	钧达股份	2,923,761.00	4.17
5	300634	彩讯股份	2,887,602.40	4.12
6	603306	华懋科技	2,841,570.00	4.06
7	600641	万业企业	2,827,857.00	4.04
8	601890	亚星锚链	2,741,151.00	3.91
9	300666	江丰电子	2,676,436.00	3.82
10	688063	派能科技	2,564,338.92	3.66
11	688617	惠泰医疗	2,477,937.00	3.54
12	002335	科华数据	2,449,615.40	3.50
13	600478	科力远	2,378,164.00	3.40
14	603063	禾望电气	2,368,156.00	3.38

15	300777	中简科技	2,359,921.00	3.37
16	300118	东方日升	2,339,569.66	3.34
17	300204	舒泰神	2,299,052.00	3.28
18	603229	奥翔药业	2,295,408.60	3.28
19	603595	东尼电子	2,274,639.00	3.25
20	300393	中来股份	2,271,467.00	3.24
21	002232	启明信息	2,262,099.00	3.23
22	002866	传艺科技	2,179,027.00	3.11
23	002773	康弘药业	2,138,695.00	3.05
24	300672	国科微	2,129,006.00	3.04
25	300776	帝尔激光	2,091,701.00	2.99
26	002868	绿康生化	2,065,507.00	2.95
27	688023	安恒信息	2,049,235.33	2.93
28	002549	凯美特气	2,024,124.00	2.89
29	688598	金博股份	2,024,088.16	2.89
30	603398	沐邦高科	2,010,417.00	2.87
31	300260	新莱应材	1,978,185.00	2.82
32	000810	创维数字	1,949,030.00	2.78
33	000762	西藏矿业	1,898,133.00	2.71
34	688516	奥特维	1,893,743.77	2.70
35	000155	川能动力	1,885,634.00	2.69
36	300208	青岛中程	1,885,316.00	2.69
37	600877	声光电科	1,875,796.00	2.68
38	003031	中瓷电子	1,866,664.60	2.67
39	002388	新亚制程	1,858,596.00	2.65
40	600685	中船防务	1,847,063.00	2.64
41	002747	埃斯顿	1,837,433.00	2.62
42	300151	昌红科技	1,833,089.00	2.62
43	002518	科士达	1,832,828.00	2.62
44	002312	川发龙蟒	1,826,199.00	2.61
45	600335	国机汽车	1,819,919.00	2.60
46	002389	航天彩虹	1,800,633.00	2.57
47	002435	长江健康	1,790,988.00	2.56
48	000546	金圆股份	1,781,162.00	2.54
49	000819	岳阳兴长	1,781,122.00	2.54
50	600172	黄河旋风	1,779,376.00	2.54
51	300861	美畅股份	1,771,339.80	2.53
52	603212	赛伍技术	1,754,419.00	2.50
53	300775	三角防务	1,754,019.00	2.50
54	300395	菲利华	1,724,921.00	2.46
55	603766	隆鑫通用	1,711,723.00	2.44
56	605123	派克新材	1,697,470.00	2.42
57	002201	正威新材	1,679,148.00	2.40

58	300125	聆达股份	1,673,628.00	2.39
59	601882	海天精工	1,669,167.00	2.38
60	002785	万里石	1,665,935.71	2.38
61	300346	南大光电	1,656,523.00	2.37
62	002190	成飞集成	1,650,223.00	2.36
63	300702	天宇股份	1,644,881.00	2.35
64	600063	皖维高新	1,630,938.00	2.33
65	603990	麦迪科技	1,621,219.27	2.31
66	000025	特力 A	1,615,145.00	2.31
67	002192	融捷股份	1,613,193.00	2.30
68	600992	贵绳股份	1,609,713.00	2.30
69	600055	万东医疗	1,608,837.00	2.30
70	300726	宏达电子	1,607,864.00	2.30
71	600184	光电股份	1,603,622.00	2.29
72	002498	汉缆股份	1,603,556.00	2.29
73	300319	麦捷科技	1,593,498.00	2.28
74	688017	绿的谐波	1,587,175.67	2.27
75	300365	恒华科技	1,580,693.00	2.26
76	603033	三维股份	1,574,846.80	2.25
77	000034	神州数码	1,565,421.00	2.24
78	000970	中科三环	1,547,588.52	2.21
79	600836	上海易连	1,546,616.00	2.21
80	002667	鞍重股份	1,519,087.00	2.17
81	688169	石头科技	1,517,989.51	2.17
82	002218	拓日新能	1,517,105.00	2.17
83	300379	东方通	1,514,828.00	2.16
84	000688	国城矿业	1,500,116.00	2.14
85	601369	陕鼓动力	1,490,618.00	2.13
86	300348	长亮科技	1,488,106.75	2.12
87	002585	双星新材	1,486,595.00	2.12
88	600916	中国黄金	1,479,892.00	2.11
89	300206	理邦仪器	1,467,317.00	2.10
90	600363	联创光电	1,466,154.00	2.09
91	688200	华峰测控	1,458,380.80	2.08
92	600732	爱旭股份	1,456,428.00	2.08
93	300604	长川科技	1,418,593.00	2.03
94	603596	伯特利	1,418,530.00	2.03
95	002707	众信旅游	1,417,813.19	2.02
96	605090	九丰能源	1,416,996.80	2.02
97	002017	东信和平	1,406,023.00	2.01
98	603396	金辰股份	1,402,672.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	841,859,544.13
卖出股票收入（成交）总额	777,227,103.58

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,008,051.12	1.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,008,051.12	1.44

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019663	21 国债 15	8,000	806,679.89	1.15
2	019679	22 国债 14	2,000	201,371.23	0.29

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。在此基础上，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为目的。基金管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	63,492.86
2	应收清算款	847,834.83
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99,315.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,010,642.88

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600459	贵研铂业	164,797.80	0.24	配股未流通

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
太平中证 1000 指数增强 A	483	128,105.37	43,318,389.26	70.0096	18,556,502.97	29.9904
太平中证 1000 指数增强 C	4,346	1,844.80	488,949.74	6.0985	7,528,532.67	93.9015
合计	4,778	14,627.96	43,807,339.00	62.6783	26,085,035.64	37.3217

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。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	太平中证 1000 指数增强 A	3,259,145.05	5.2673
	太平中证 1000 指数增强 C	58,443.64	0.7290
	合计	3,317,588.69	4.7467

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究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本开放式基金	太平中证 1000 指数增强 A	>100
	太平中证 1000 指数增强 C	0
	合计	>100

§ 10 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	51,433,582.81	10,610,872.83
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	197,373,106.73	3,032,051.19
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	61,874,892.23	8,017,482.41

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动情况

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

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

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

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

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务，报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为贰万捌仟元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本公司及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
天风证券	2	1,618,972,420.01	100.00	310,406.78	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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
天风证券	2,645,488.39	100.00	3,648,000.00	100.00	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2022 年 4 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	中国证监会规定媒介	2022 年 5 月 13 日
3	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 7 月 21 日
4	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 8 月 15 日
5	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会规定媒介	2022 年 8 月 31 日
6	太平基金管理有限公司关于太平中证 1000 指数增强型证券投资基金增加基金销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 10 月 15 日
7	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加玄元保险代理有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 10 月 17 日
8	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会规定媒介	2022 年 10 月 26 日
9	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加和耕传承基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022 年 11 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	20220531-20221016, 20221130-20221215	13,782,582.80	-	-	13,782,582.80	19.7197
	5	20221017-20221231	0.00	29,336,006.26	-	29,336,006.26	41.9731
产品特有风险							
<p>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。</p>							

注：报告期初、期末同一投资者通过多个基金账户持有本基金的合并计算。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平中证 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

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

客户服务电话：400-028-8699、021-61560999

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日