

# 太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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等内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	46
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	46

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 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</b>
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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 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	63,437,379.31 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	60,203,730.25 份	3,233,649.06 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	陆志俊
	联系电话	021-38556613	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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 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	4,384,038.18	583,371.44
本期利润	6,394,790.64	942,991.28
加权平均基金份额本期利润	0.1064	0.1344
本期加权平均净值利润率	9.84%	12.48%
本期基金份额净值增长率	10.37%	10.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	期末可供分配利润	326,101.70
	期末可供分配基	0.1008

金份额利润		
期末基金资产净值	66,605,874.22	3,560,079.82
期末基金份额净值	1.1063	1.1009
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.63%	10.09%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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）。

3、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	1.47%	0.94%	0.59%	0.99%	0.88%	-0.05%
过去三个月	1.81%	0.83%	-3.77%	0.87%	5.58%	-0.04%
过去六个月	10.37%	0.81%	4.87%	0.84%	5.50%	-0.03%
过去一年	-0.13%	1.08%	-5.27%	1.05%	5.14%	0.03%
自基金合同生效起至今	10.63%	1.05%	19.21%	1.12%	-8.58%	-0.07%

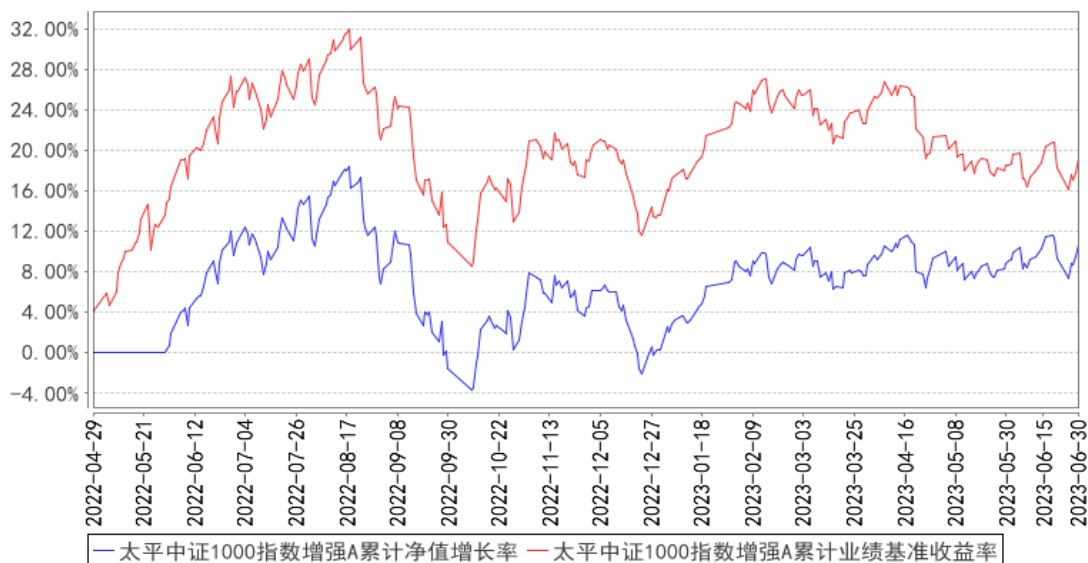
太平中证 1000 指数增强 C

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	1.43%	0.94%	0.59%	0.99%	0.84%	-0.05%
过去三个月	1.70%	0.83%	-3.77%	0.87%	5.47%	-0.04%
过去六个月	10.13%	0.81%	4.87%	0.84%	5.26%	-0.03%

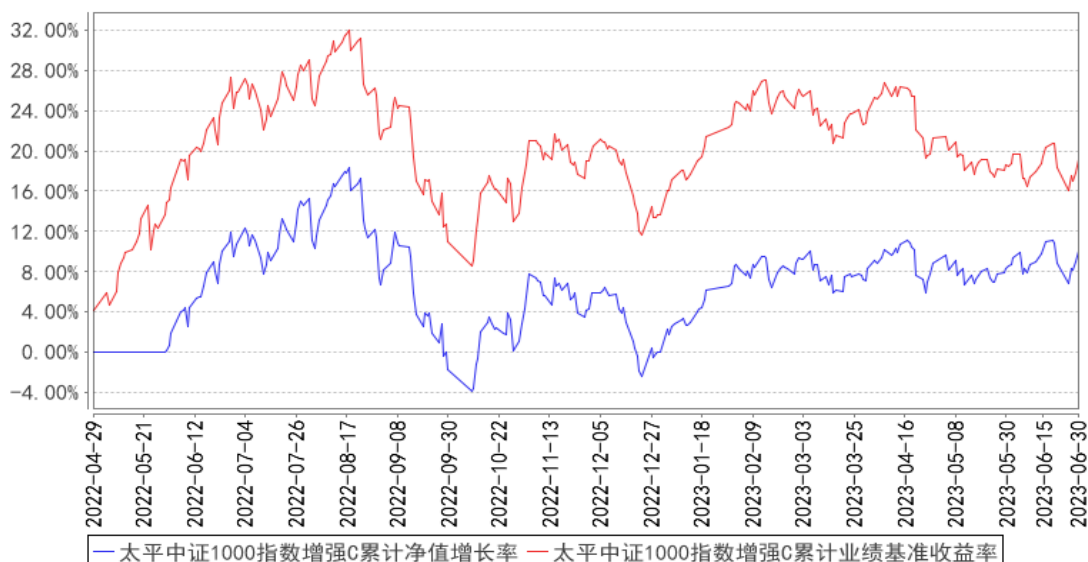
过去一年	-0.53%	1.08%	-5.27%	1.05%	4.74%	0.03%
自基金合同生效起 至今	10.09%	1.05%	19.21%	1.12%	-9.12%	-0.07%

### 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：本基金基金合同于 2022 年 04 月 29 日生效。本基金的建仓期为 6 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。



## § 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 33 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。
赵鑫淼	本基金的基金经理助理、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助理	2023 年 1 月 13 日	-	4 年	上海交通大学应用统计学硕士，具有证券投资基金从业资格。2019 年 4 月起任职于德邦基金管理有限公司，任量化研究员。2022 年 12 月加入本公司，从事量化投资研究工作。2023 年 1 月 13 日起担任太平中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理助理。2023 年 1 月 13 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助理。

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、证券投资基金从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定；

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 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，虽然市场呈现较为明显的结构化行情，低估值风格及 TMT 相关行业板块出现了较为明显的上涨，但本基金充分发挥风格中性以及行业中性的优势，在结构化行情中较好的控制住了跟踪误差。同时报告期内量化选股模型表现较好，帮助管理人实现了超越基准的目标。

#### 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 10.37%，同期业绩比较基准为 4.87%；太平中证 1000 指数增强 C 的净值收益率为 10.13%，同期业绩比较基准为 4.87%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内，经济恢复动能出现放缓迹象，PMI 冲高回落。从需求结构看，二季度外需出现走弱迹象，1-6 月出口金额（以美元计）累计同比下降，低于一季度末 1.7 个百分点。内需中，房地产开发投资依然疲软，制造业投资同比增速回落。由于去年的低基数效应和服务、文娱等接触型消费的拉动，消费回暖但修复节奏分化。CPI 和 PPI 同比持续回落，通胀不会是今年的主线。

展望下半年，宏观上美联储加息进入尾声。国内资本流出压力或将缓和，利好证券市场。随着证券市场企稳，下半年权益市场低估值板块或有一定超额收益。

#### 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

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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

本报告期内，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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,055,154.62	3,258,250.14
结算备付金		338,291.74	1,165,184.49
存出保证金		41,660.23	63,492.86
交易性金融资产	6.4.7.2	66,202,274.56	66,551,061.45
其中：股票投资		66,202,274.56	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	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		531,388.61	847,834.83
应收股利		-	-
应收申购款		19,832.58	99,315.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		71,188,602.34	71,985,138.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	768,643.90
应付清算款		676,937.71	743,559.69
应付赎回款		48,407.68	71,839.07
应付管理人报酬		57,600.76	60,213.31
应付托管费		8,640.09	9,031.98
应付销售服务费		1,314.21	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	6.4.7.9	229,747.85	292,137.39
负债合计		1,022,648.30	1,947,873.38
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	63,437,379.31	69,892,374.64
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	6,728,574.73	144,890.94
净资产合计		70,165,954.04	70,037,265.58
负债和净资产总计		71,188,602.34	71,985,138.96

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 63,437,379.31 份，其中 A 类基金份额总额为 60,203,730.25 份，基金份额净值 1.1063 元；C 类基金份额总额为 3,233,649.06 份，基金份额净值 1.1009 元。

## 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 29 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		7,824,412.46	4,579,171.78
1. 利息收入		21,859.74	266,465.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,859.74	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）		5,427,774.05	3,573,022.39
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,740,759.37	3,473,541.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	8,073.28	-
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	678,941.40	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	2,370,372.30	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	4,406.37	641.15
<b>减：二、营业总支出</b>		486,630.54	292,016.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	360,936.57	218,256.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	54,140.45	32,738.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	15,353.37	321.24
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,644.04	-
其中：卖出回购金融资产支 出		2,644.04	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-

7. 税金及附加		0.02	-
8. 其他费用	6.4.7.23	53,556.09	40,699.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,337,781.92	4,287,155.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,337,781.92	4,287,155.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,337,781.92	4,287,155.75

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	69,892,374.64	-	144,890.94	70,037,265.58
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）	69,892,374.64	-	144,890.94	70,037,265.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,454,995.33	-	6,583,683.79	128,688.46
（一）、综合收益总额	-	-	7,337,781.92	7,337,781.92
（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）	-6,454,995.33	-	-754,098.13	-7,209,093.46
其中：1. 基金申购款	20,068,683.34	-	1,538,156.80	21,606,840.14
2. 基金赎回款	-26,523,678.67	-	-2,292,254.93	-28,815,933.60
（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、本期期末净资产（基金净值）	63,437,379.31	-	6,728,574.73	70,165,954.04
项目	上年度可比期间			
	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金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-159,519,585.17	-	959,860.62	-158,559,724.55
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、本期期末净资产(基金净值)	48,733,491.75	-	5,247,016.37	53,980,508.12

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>邓先虎</u>	<u>邓先虎</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 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合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 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要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况、2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 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,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。

## 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,055,154.62
等于：本金	4,054,269.17
加：应计利息	885.45
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	4,055,154.62

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	66,326,043.40	-	66,202,274.56	-123,768.84
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	66,326,043.40	-	66,202,274.56	-123,768.84

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 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期货合约。

##### 6.4.7.3.3 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黄金衍生品。

#### 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

本基金于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

本基金于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

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 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券投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 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。

##### 6.4.7.6.2 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。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 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。

##### 6.4.7.7.2 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。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金于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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	25.93
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	56,165.83
其中：交易所市场	56,165.83
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	13,884.51
预提信息披露费	159,671.58

合计	229,747.85
----	------------

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,874,892.23	61,874,892.23
本期申购	5,694,964.85	5,694,964.85
本期赎回（以“-”号填列）	-7,366,126.83	-7,366,126.83
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	60,203,730.25	60,203,730.25

太平中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,017,482.41	8,017,482.41
本期申购	14,373,718.49	14,373,718.49
本期赎回（以“-”号填列）	-19,157,551.84	-19,157,551.84
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	3,233,649.06	3,233,649.06

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

本基金于本报告期间未发生其他综合收益。

#### 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
上年度末	2,092,647.53	-1,944,317.25	148,330.28
本期利润	4,384,038.18	2,010,752.46	6,394,790.64
本期基金份额交易产生的变动数	-83,500.57	-57,476.38	-140,976.95
其中：基金申购款	562,019.29	-38,687.78	523,331.51
基金赎回款	-645,519.86	-18,788.60	-664,308.46
本期已分配利润	-	-	-

本期末	6,393,185.14	8,958.83	6,402,143.97
-----	--------------	----------	--------------

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
上年度末	248,012.56	-251,451.90	-3,439.34
本期利润	583,371.44	359,619.84	942,991.28
本期基金份额交易产生的变动数	-505,282.30	-107,838.88	-613,121.18
其中：基金申购款	1,170,397.99	-155,572.70	1,014,825.29
基金赎回款	-1,675,680.29	47,733.82	-1,627,946.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	326,101.70	329.06	326,430.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	15,921.37
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	5,482.31
其他	456.06
合计	21,859.74

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,740,759.37
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	4,740,759.37

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	403,779,800.53
减：卖出股票成本总额	398,431,169.90
减：交易费用	607,871.26
买卖股票差价收入	4,740,759.37



#### 6.4.7.14.3 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。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,644.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,428.49
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	8,073.28

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,054,574.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,040,708.00
减：应计利息总额	9,436.17
减：交易费用	1.77
买卖债券差价收入	4,428.49

##### 6.4.7.15.3 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。

##### 6.4.7.15.4 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。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 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。

##### 6.4.7.16.2 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。

##### 6.4.7.16.3 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。

#### 6.4.7.16.4 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。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 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。

##### 6.4.7.17.2 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。

##### 6.4.7.17.3 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。

##### 6.4.7.17.4 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。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 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。

##### 6.4.7.18.2 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。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	678,941.40
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	678,941.40

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,370,372.30
股票投资	2,365,924.30
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	2,370,372.30

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,406.37
合计	4,406.37

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	13,884.51
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	53,556.09

#### 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。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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

### 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金在报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	360,936.57	218,256.48
其中：支付销售机构的客户维护费	76,647.76	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 1.00%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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	54,140.45	32,738.47

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

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 A	太平中证 1000 指数增强 C	合计
太平基金	-	5,613.53	5,613.53
交通银行	-	75.27	75.27
合计	-	5,688.80	5,688.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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 A	太平中证 1000 指数增强 C	合计
太平基金	-	13.71	13.71
交通银行	-	136.28	136.28
合计	-	149.99	149.99

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

#### 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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。

##### 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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。

#### 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。

##### 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

份额单位：份

太平中证 1000 指数增强 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 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 (%)	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	48.7279	29,336,006.26	47.4118

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
交通银行	4,055,154.62	15,921.37	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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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（2023 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。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2023 年 06 月 30 日，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

于 2023 年 06 月 30 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2023 年 06 月 30 日，本基金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

于 2023 年 06 月 30 日，本基金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

其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。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	201,371.23
合计	-	201,371.23

注：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

截至本报告期末及上年度，本基金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

截至本报告期末及上年度，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	806,679.89



合计	-	806,679.89
----	---	------------

注：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

截至本报告期末及上年度，本基金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

截至本报告期末及上年度，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2023 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(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。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

##### 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上市公司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 2023 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 2023 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	4,055,154.62	-	-	-	4,055,154.62
结算备付金	338,291.74	-	-	-	338,291.74
存出保证金	41,660.23	-	-	-	41,660.23
交易性金融资产	-	-	-	66,202,274.56	66,202,274.56
应收申购款	-	-	-	19,832.58	19,832.58
应收清算款	-	-	-	531,388.61	531,388.61
资产总计	4,435,106.59	-	-	66,753,495.75	71,188,602.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	48,407.68	48,407.68
应付管理人报酬	-	-	-	57,600.76	57,600.76
应付托管费	-	-	-	8,640.09	8,640.09
应付清算款	-	-	-	676,937.71	676,937.71
应付销售服务费	-	-	-	1,314.21	1,314.21
其他负债	-	-	-	229,747.85	229,747.85
负债总计	-	-	-	1,022,648.30	1,022,648.30
利率敏感度缺口	4,435,106.59	-	-	65,730,847.45	70,165,954.04
上年度末 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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 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（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	66,202,274.56	94.35	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	66,202,274.56	94.35	65,543,010.33	93.58

6.4.13.4.3.2 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		
分析	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	2,309,337.76	2,147,926.24
沪深 300 指数下降 5%	-2,309,337.76	-2,147,926.24	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	66,202,274.56	65,238,982.53
第二层次	-	1,312,078.92
第三层次	-	-
合计	66,202,274.56	66,551,061.45

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 2023 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：无)。

### 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 2023 年 06 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	66,202,274.56	93.00
	其中：股票	66,202,274.56	93.00
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	4,393,446.36	6.17
8	其他各项资产	592,881.42	0.83
9	合计	71,188,602.34	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	-	-
B	采矿业	2,137,155.00	3.05
C	制造业	33,307,454.47	47.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,012,752.00	2.87
E	建筑业	788,123.00	1.12
F	批发和零售业	3,680,492.40	5.25
G	交通运输、仓储和	1,543,075.00	2.20

	邮政业		
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,728,154.19	6.74
J	金融业	1,394,369.30	1.99
K	房地产业	510,051.00	0.73
L	租赁和商务服务业	1,834,601.00	2.61
M	科学研究和技术服务业	171,395.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	491,050.00	0.70
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	3,205,667.00	4.57
S	综合	-	-
	合计	55,804,339.36	79.53

### 7.2.2 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	-	-
B	采矿业	441,412.00	0.63
C	制造业	5,236,366.31	7.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,115,631.00	1.59
E	建筑业	984,464.00	1.40
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	469,576.00	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,761,052.00	2.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	389,433.89	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,397,935.20	14.82

### 7.2.3 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。

### 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

#### 7.3.1 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	600771	广誉远	18,100	638,387.00	0.91
2	600776	东方通信	44,300	631,275.00	0.90
3	002747	埃斯顿	22,500	630,000.00	0.90
4	600098	广州发展	100,900	623,562.00	0.89
5	601222	林洋能源	75,400	617,526.00	0.88
6	002815	崇达技术	47,900	596,355.00	0.85
7	300185	通裕重工	213,300	595,107.00	0.85
8	603103	横店影视	35,200	592,768.00	0.84
9	300130	新国都	20,800	589,264.00	0.84
10	002085	万丰奥威	84,200	583,506.00	0.83
11	600583	海油工程	99,500	582,075.00	0.83
12	000028	国药一致	13,340	581,757.40	0.83
13	300294	博雅生物	15,800	573,224.00	0.82
14	002332	仙琚制药	43,200	572,400.00	0.82
15	301090	华润材料	45,300	571,686.00	0.81
16	600201	生物股份	60,000	570,600.00	0.81
17	000761	本钢板材	142,200	568,800.00	0.81
18	002335	科华数据	15,800	568,010.00	0.81
19	600057	厦门象屿	65,200	567,240.00	0.81
20	688037	芯源微	3,317	567,041.15	0.81
21	000426	兴业矿业	63,700	565,656.00	0.81
22	600562	国睿科技	34,800	563,760.00	0.80
23	600977	中国电影	40,100	563,405.00	0.80
24	002424	贵州百灵	62,700	563,046.00	0.80
25	002038	双鹭药业	55,800	563,022.00	0.80
26	002151	北斗星通	16,000	562,560.00	0.80
27	300679	电连技术	17,000	561,850.00	0.80



28	688139	海尔生物	10,914	561,743.58	0.80
29	002461	珠江啤酒	63,500	559,435.00	0.80
30	601369	陕鼓动力	61,200	557,532.00	0.79
31	300133	华策影视	78,500	556,565.00	0.79
32	688088	虹软科技	13,019	556,562.25	0.79
33	002727	一心堂	21,000	554,400.00	0.79
34	300674	宇信科技	31,300	553,384.00	0.79
35	600586	金晶科技	71,600	552,752.00	0.79
36	600483	福能股份	47,800	552,090.00	0.79
37	002130	沃尔核材	67,900	551,348.00	0.79
38	600750	江中药业	25,100	550,443.00	0.78
39	603466	风语筑	39,600	550,440.00	0.78
40	600267	海正药业	48,300	549,654.00	0.78
41	600446	金证股份	37,800	549,612.00	0.78
42	002697	红旗连锁	93,000	543,120.00	0.77
43	688425	铁建重工	112,019	538,811.39	0.77
44	688128	中国电研	21,121	538,585.50	0.77
45	300634	彩讯股份	20,300	535,920.00	0.76
46	688608	恒玄科技	4,409	533,621.27	0.76
47	601126	四方股份	35,100	533,169.00	0.76
48	600248	陕西建工	111,700	532,809.00	0.76
49	603043	广州酒家	18,800	531,288.00	0.76
50	000582	北部湾港	69,600	528,960.00	0.75
51	000030	富奥股份	104,800	528,192.00	0.75
52	688366	昊海生科	6,259	527,132.98	0.75
53	300232	洲明科技	57,400	524,636.00	0.75
54	688166	博瑞医药	23,845	524,351.55	0.75
55	000950	重药控股	77,900	524,267.00	0.75
56	002651	利君股份	67,200	522,144.00	0.74
57	002215	诺普信	69,400	521,194.00	0.74
58	601019	山东出版	56,700	519,939.00	0.74
59	002158	汉钟精机	20,800	519,168.00	0.74
60	603567	珍宝岛	34,500	516,120.00	0.74
61	002287	奇正藏药	21,500	513,850.00	0.73
62	603363	傲农生物	55,900	512,603.00	0.73
63	601279	英利汽车	92,300	511,342.00	0.73
64	603733	仙鹤股份	24,500	510,825.00	0.73
65	002053	云南能投	45,500	510,510.00	0.73
66	000603	盛达资源	42,200	510,198.00	0.73
67	600639	浦东金桥	41,100	510,051.00	0.73
68	600184	光电股份	38,300	502,879.00	0.72
69	603053	成都燃气	49,900	502,493.00	0.72
70	688318	财富趋势	5,018	501,649.46	0.71

71	000061	农产品	83,400	499,566.00	0.71
72	300811	铂科新材	8,400	499,296.00	0.71
73	603013	亚普股份	31,800	498,624.00	0.71
74	603025	大豪科技	39,800	491,928.00	0.70
75	000567	海德股份	38,315	491,198.30	0.70
76	002549	凯美特气	42,700	491,050.00	0.70
77	603071	物产环能	29,500	489,405.00	0.70
78	603983	丸美股份	15,100	488,485.00	0.70
79	603719	良品铺子	19,500	487,695.00	0.70
80	002946	新乳业	33,900	486,465.00	0.69
81	300755	华致酒行	21,600	485,352.00	0.69
82	688233	神工股份	15,221	480,679.18	0.69
83	600403	大有能源	116,600	479,226.00	0.68
84	600197	伊力特	17,500	475,475.00	0.68
85	002544	普天科技	20,600	471,740.00	0.67
86	688158	优刻得	24,646	465,316.48	0.66
87	002020	京新药业	35,100	449,982.00	0.64
88	300035	中科电气	36,400	437,528.00	0.62
89	000555	神州信息	34,800	428,040.00	0.61
90	601801	皖新传媒	45,000	422,550.00	0.60
91	600990	四创电子	13,030	412,269.20	0.59
92	000058	深赛格	66,300	409,734.00	0.58
93	601963	重庆银行	51,700	408,947.00	0.58
94	603093	南华期货	35,100	382,239.00	0.54
95	300502	新易盛	5,600	380,632.00	0.54
96	002928	华夏航空	44,200	373,490.00	0.53
97	600787	中储股份	69,100	372,449.00	0.53
98	002344	海宁皮城	75,700	358,061.00	0.51
99	000528	柳工	42,200	333,380.00	0.48
100	300693	盛弘股份	7,500	276,900.00	0.39
101	002320	海峡股份	44,400	268,176.00	0.38
102	300226	上海钢联	8,200	265,680.00	0.38
103	002233	塔牌集团	32,700	252,444.00	0.36
104	002645	华宏科技	20,500	251,330.00	0.36
105	603236	移远通信	4,200	242,382.00	0.35
106	605376	博迁新材	7,600	238,488.00	0.34
107	002605	姚记科技	4,200	195,006.00	0.28
108	000685	中山公用	25,700	194,549.00	0.28
109	600986	浙文互联	28,000	179,200.00	0.26
110	002895	川恒股份	8,900	175,330.00	0.25
111	601965	中国汽研	8,300	171,395.00	0.24
112	000818	航锦科技	5,100	170,187.00	0.24
113	603985	恒润股份	8,100	169,857.00	0.24

114	000966	长源电力	25,100	140,058.00	0.20
115	600502	安徽建工	25,300	133,584.00	0.19
116	000032	深桑达 A	3,700	121,730.00	0.17
117	600572	康恩贝	16,600	113,710.00	0.16
118	000969	安泰科技	11,800	111,746.00	0.16
119	600864	哈投股份	21,100	107,821.00	0.15
120	002351	漫步者	5,200	107,536.00	0.15
121	601567	三星医疗	8,500	107,355.00	0.15
122	688100	威胜信息	2,407	71,752.67	0.10
123	300101	振芯科技	3,500	67,865.00	0.10
124	300170	汉得信息	1,400	16,156.00	0.02
125	300767	震安科技	600	15,216.00	0.02
126	300031	宝通科技	400	9,888.00	0.01
127	300783	三只松鼠	500	9,770.00	0.01
128	601952	苏垦农发	700	8,148.00	0.01
129	000927	中国铁物	1,700	4,726.00	0.01
130	000686	东北证券	600	4,164.00	0.01
131	688598	金博股份	10	1,715.00	0.00

7.3.2 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	300798	锦鸡股份	83,100	594,996.00	0.85
2	601618	中国中冶	135,200	536,744.00	0.76
3	603615	茶花股份	54,200	511,648.00	0.73
4	300626	华瑞股份	48,800	506,056.00	0.72
5	601158	重庆水务	88,900	494,284.00	0.70
6	300868	杰美特	26,400	480,480.00	0.68
7	603958	哈森股份	62,600	480,142.00	0.68
8	688013	天臣医疗	20,112	476,855.52	0.68
9	688571	杭华股份	75,277	474,997.87	0.68
10	601688	华泰证券	34,200	470,934.00	0.67
11	688616	西力科技	35,504	469,717.92	0.67
12	601006	大秦铁路	63,200	469,576.00	0.67
13	600025	华能水电	64,900	462,737.00	0.66
14	603879	永悦科技	67,600	458,328.00	0.65
15	601169	北京银行	98,600	456,518.00	0.65
16	601668	中国建筑	78,000	447,720.00	0.64
17	601898	中煤能源	52,300	441,412.00	0.63
18	688287	观典防务	26,839	389,433.89	0.56
19	600015	华夏银行	71,600	387,356.00	0.55
20	601211	国泰君安	21,600	302,184.00	0.43
21	300905	宝丽迪	12,000	224,640.00	0.32
22	301008	宏昌科技	5,800	163,154.00	0.23

23	603511	爱慕股份	9,400	161,680.00	0.23
24	003816	中国广核	51,000	158,610.00	0.23
25	600919	江苏银行	19,600	144,060.00	0.21
26	603839	安正时尚	14,800	111,296.00	0.16
27	603677	奇精机械	6,700	90,651.00	0.13
28	301182	凯旺科技	1,200	27,564.00	0.04
29	600597	光明乳业	400	4,160.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002085	万丰奥威	2,170,556.00	3.10
2	601567	三星医疗	1,885,905.00	2.69
3	603985	恒润股份	1,753,980.00	2.50
4	000426	兴业矿业	1,730,336.00	2.47
5	002549	凯美特气	1,727,084.00	2.47
6	300034	钢研高纳	1,695,239.00	2.42
7	002906	华阳集团	1,694,684.00	2.42
8	003016	欣贺股份	1,682,994.00	2.40
9	301071	力量钻石	1,644,284.00	2.35
10	603636	南威软件	1,637,621.00	2.34
11	688166	博瑞医药	1,596,209.98	2.28
12	300393	中来股份	1,584,108.00	2.26
13	688158	优刻得	1,577,913.22	2.25
14	600458	时代新材	1,536,612.00	2.19
15	603363	傲农生物	1,522,106.00	2.17
16	600007	中国国贸	1,521,558.00	2.17
17	300634	彩讯股份	1,517,992.00	2.17
18	300679	电连技术	1,506,654.00	2.15
19	601827	三峰环境	1,494,768.00	2.13
20	000567	海德股份	1,472,525.00	2.10
21	300455	康拓红外	1,470,151.00	2.10
22	002727	一心堂	1,468,499.00	2.10
23	603396	金辰股份	1,435,090.00	2.05
24	600990	四创电子	1,434,879.60	2.05
25	605111	新洁能	1,423,098.20	2.03
26	601929	吉视传媒	1,421,941.00	2.03
27	603698	航天工程	1,404,060.00	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。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002085	万丰奥威	2,157,636.00	3.08
2	002906	华阳集团	2,141,844.00	3.06
3	000426	兴业矿业	1,915,197.00	2.73
4	002698	博实股份	1,805,383.80	2.58
5	002463	沪电股份	1,792,295.00	2.56
6	601567	三星医疗	1,786,161.00	2.55
7	300034	钢研高纳	1,769,521.00	2.53
8	600363	联创光电	1,727,884.00	2.47
9	003016	欣贺股份	1,681,050.00	2.40
10	601929	吉视传媒	1,647,259.00	2.35
11	603636	南威软件	1,620,684.00	2.31
12	301071	力量钻石	1,608,915.60	2.30
13	600007	中国国贸	1,604,332.00	2.29
14	603985	恒润股份	1,594,865.00	2.28
15	600458	时代新材	1,582,504.00	2.26
16	002317	众生药业	1,571,458.00	2.24
17	300393	中来股份	1,516,870.00	2.17
18	300455	康拓红外	1,513,909.00	2.16
19	601519	大智慧	1,474,732.00	2.11
20	603698	航天工程	1,471,449.00	2.10
21	601827	三峰环境	1,466,244.00	2.09
22	301039	中集车辆	1,451,265.00	2.07
23	300777	中简科技	1,446,960.00	2.07
24	688158	优刻得	1,424,718.29	2.03
25	300487	蓝晓科技	1,414,579.00	2.02
26	688037	芯源微	1,411,206.29	2.01

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	396,724,509.83
卖出股票收入（成交）总额	403,779,800.53

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。

### 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。

#### 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。

#### 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	41,660.23
2	应收清算款	531,388.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,832.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	592,881.42

### 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

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 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。

### 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	391	153,973.73	43,318,389.26	71.9530	16,885,340.99	28.0470
太平中证 1000 指数增强 C	2,062	1,568.21	0.00	0.0000	3,233,649.06	100.0000
合计	2,426	26,148.96	43,318,389.26	68.2853	20,118,990.05	31.7147

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	太平中证 1000 指数增强 A	3,341,560.21	5.5504
	太平中证 1000 指数增强 C	58,442.56	1.8073
	合计	3,400,002.77	5.3596

### 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	太平中证 1000 指数增强 A	10~50

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 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

## § 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
本报告期期初基金份额总额	61,874,892.23	8,017,482.41
本报告期基金总申购份额	5,694,964.85	14,373,718.49
减：本报告期基金总赎回份额	7,366,126.83	19,157,551.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	60,203,730.25	3,233,649.06

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于 2023 年 6 月 17 日发布公告，自 2023 年 6 月 16 日起董晓亮先生不再担任公司副总经理职务。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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



及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

#### 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

##### 10.6.1 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。

##### 10.6.2 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，托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 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	800,504,310.36	100.00	141,032.20	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

本基金本报告期内无新增交易单元。

### 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	1,045,144.30	100.00	800,000.00	100.00	-	-

### 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 2022 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 1 月 20 日
2	太平基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 8 日
3	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 3 月 30 日
4	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)(2023 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 20 日
5	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 20 日
6	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 20 日
7	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2023 年 4 月 21 日
8	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加上海攀赢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	2023 年 5 月 31 日
9	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加上海挖财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	2023 年 5 月 31 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)

		间区间					
机构	1	20230206— 20230326 20230505— 20230630	13,782,58 2.80		-	13,782,582.80	21.72 63
机构	2	20230101-202 30630	29,336,00 6.26		-	29,336,006.26	46.24 40
产品特有风险							
本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况，可能会出现集中赎回或巨额赎回从而引发基金净值剧烈波动或份额净值尾差风险，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平中证 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

2023 年 8 月 31 日