

# 太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 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 2024 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
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	39
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	50
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	50
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	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 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	160,645,903.04 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	80,523,520.31 份	80,122,382.73 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
		方圆
		95559

电子邮箱	zhaolin@taipingfund.com.cn	fangy_20@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(2024 年 1 月 1 日-2024 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	-2,104,176.39	-2,153,367.08
本期利润	-10,482,339.40	-7,666,673.76
加权平均基金份额 本期利润	-0.1061	-0.1063
本期加权平均净 值利润率	-10.72%	-10.82%
本期基金份额净 值增长率	-12.31%	-12.48%
3.1.2 期末数 和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-5,880,366.51	-6,507,510.87

期末可供分配基金份额利润	-0.0730	-0.0812
期末基金资产净值	74,643,153.80	73,614,871.86
期末基金份额净值	0.9270	0.9188
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-7.30%	-8.12%

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	-8.36%	1.38%	-8.15%	1.36%	-0.21%	0.02%
过去三个月	-7.32%	1.50%	-9.51%	1.42%	2.19%	0.08%
过去六个月	-12.31%	1.88%	-15.97%	1.87%	3.66%	0.01%
过去一年	-16.21%	1.44%	-24.61%	1.47%	8.40%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-7.30%	1.25%	-10.12%	1.29%	2.82%	-0.04%

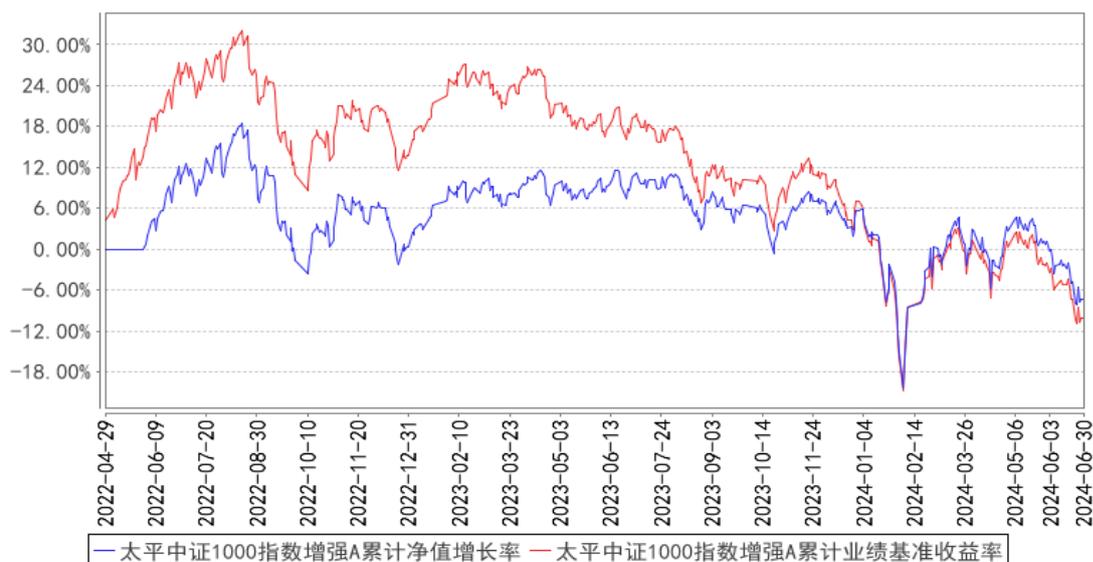
太平中证 1000 指数增强 C

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	-8.39%	1.38%	-8.15%	1.36%	-0.24%	0.02%
过去三个月	-7.42%	1.50%	-9.51%	1.42%	2.09%	0.08%
过去六个月	-12.48%	1.88%	-15.97%	1.87%	3.49%	0.01%

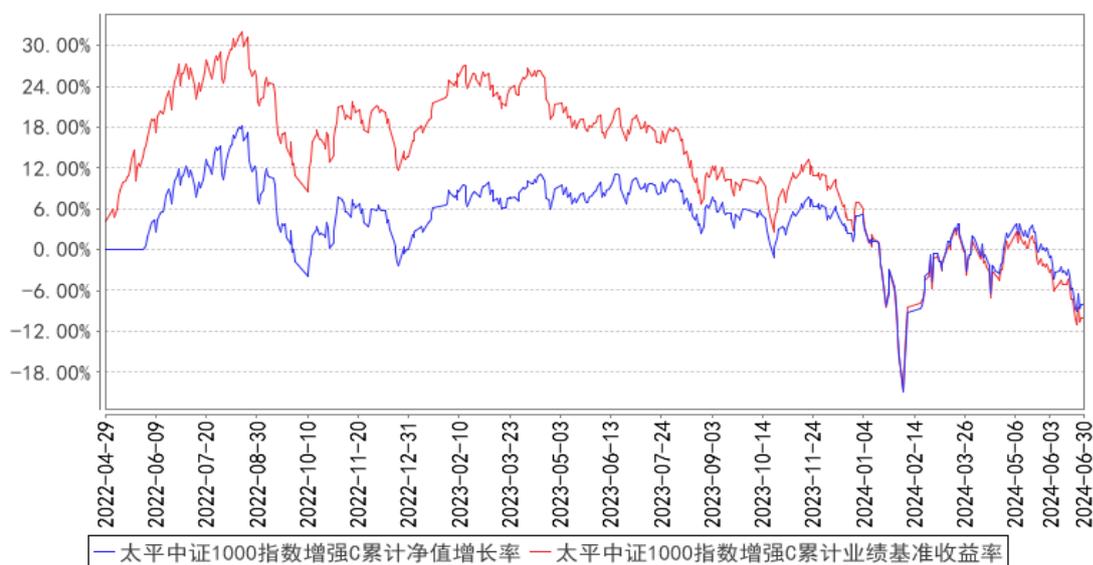
过去一年	-16.54%	1.44%	-24.61%	1.47%	8.07%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-8.12%	1.25%	-10.12%	1.29%	2.00%	-0.04%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



注：本基金基金合同生效日为 2022 年 4 月 29 日，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 39 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	2022 年 4 月 29 日	-	7 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	2023 年 1 月 13 日	-	5 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，本基金业绩高于基准。受益于有效的跟踪误差控制，报告期内基金与基准一致性较高。

##### 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-12.31%，同期业绩比较基准为-15.97%；太平中证 1000 指数增强 C 的净值收益率为-12.48%，同期业绩比较基准为-15.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在回顾过去的半年，我们注意到市场情绪经历了一段较为悲观的时期，这种情绪在股价中得到了过度的反映。从估值的角度来看，中证 1000 指数的市盈率已经接近历史低点，这为我们提供了一个值得关注的投资机会。

我们认为，市场的悲观情绪可能并未完全考虑到宏观经济的基本面因素。当前，尽管面临一些挑战，但国内经济的韧性和长期增长潜力依然存在。此外，政策层面的支持也在不断加强，为市场提供了稳定的基础。

特别是退市新规的推出，以及对上市公司的高标准监管，这不仅有助于提高资本市场的整体质量，也有利于促进市场的长期健康稳定发展。虽然市场对于新规的初步反应可能有些过度，导致中证 1000 等指数的估值承受了压力，但我们认为这种压力更多是短期的，而非长期趋势。

展望下半年，我们对中证 1000 指数的表现持相对乐观的态度。随着市场情绪的逐步回暖和投资者对新规影响的深入理解，我们预计中证 1000 的估值将得到合理的修复。此外，我们也将密切关注行业发展趋势和宏观经济指标，以便更好地把握投资机会。

在行业层面，我们将继续关注那些具有创新能力、市场竞争力强的优质企业。我们相信，这些企业能够在不断变化的市场环境中展现出更强的适应性和增长潜力。

总体而言，虽然市场短期内可能仍会面临波动，但我们对资本市场的长期前景保持信心。我们将以审慎的态度，结合深入的市场分析和严格的风险管理，为投资者寻求稳健的投资回报。

#### 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，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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。公司管理层下设立估值委员会，常任委员由公司总经理、分管投资部门、研究部、运营部高管及稽核风控部、投资部门（含权益投资部、专户业务部、固定收益投资部）、研究部、基金运营部等部门负责人担任。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的真实、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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	9,241,353.64	8,422,164.22
结算备付金		3,465.10	900,716.71
存出保证金		-	43,998.77
交易性金融资产	6.4.7.2	139,673,275.51	111,560,590.81
其中：股票投资		139,673,275.51	111,560,590.81
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		118,086.07	3,703,999.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		149,036,180.32	124,631,469.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		-	-
应付清算款		-	1,328,869.97
应付赎回款		321,503.47	386,177.21
应付管理人报酬		132,058.16	92,741.72
应付托管费		19,808.73	13,911.26
应付销售服务费		25,981.45	12,854.82
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	278,802.85	337,996.62
负债合计		778,154.66	2,172,551.60
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	160,645,903.04	116,140,703.45
未分配利润	6.4.7.11	-12,387,877.38	6,318,214.63
净资产合计		148,258,025.66	122,458,918.08
负债和净资产总计		149,036,180.32	124,631,469.68

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 160,645,903.04 份。其中 A 类基金份额净值 0.9270 元，A 类基金份额 80,523,520.31 份；C 类基金份额净值 0.9188 元，C 类基金份额

80,122,382.73 份。

## 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-16,971,353.47	7,824,412.46
1. 利息收入		26,634.00	21,859.74
其中：存款利息收入	6.4.7.12	26,634.00	21,859.74
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,214,258.38	5,427,774.05
其中：股票投资收益	6.4.7.13	-4,977,159.86	4,740,759.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	8,073.28
资产支持证券投资	6.4.7.15	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	1,762,901.48	678,941.40
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-13,891,469.69	2,370,372.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	107,740.60	4,406.37
<b>减：二、营业总支出</b>		1,177,659.69	486,630.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	836,764.30	360,936.57
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	125,514.70	54,140.45
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	140,789.81	15,353.37
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	2,644.04
其中：卖出回购金融资产		-	2,644.04

支出			
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		-	0.02
8. 其他费用	6.4.7.22	74,590.88	53,556.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-18,149,013.16	7,337,781.92
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-18,149,013.16	7,337,781.92
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-18,149,013.16	7,337,781.92

### 6.3 净资产变动表

会计主体：太平中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	116,140,703.45	-	6,318,214.63	122,458,918.08
二、本期期初净资产	116,140,703.45	-	6,318,214.63	122,458,918.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	44,505,199.59	-	-18,706,092.01	25,799,107.58
（一）、综合收益总额	-	-	-18,149,013.16	-18,149,013.16
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	44,505,199.59	-	-557,078.85	43,948,120.74
其中：1. 基金申购款	204,326,629.17	-	-248,974.97	204,077,654.20
2. 基金赎回款	-159,821,429.58	-	-308,103.88	-160,129,533.46
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号	-	-	-	-

填列)				
四、本期期末净资产	160,645,903.04	-	-12,387,877.38	148,258,025.66
项目	上年度可比期间 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	69,892,374.64	-	144,890.94	70,037,265.58
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	63,437,379.31	-	6,728,574.73	70,165,954.04

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：

曹琦

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

## 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》批准,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 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产

品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,433,756.30
等于：本金	2,433,512.86
加：应计利息	243.44
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	6,807,597.34
等于：本金	6,807,190.36
加：应计利息	406.98
减：坏账准备	-
合计	9,241,353.64

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	153,859,139.24	-	139,673,275.51	-14,185,863.73
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	153,859,139.24	-	139,673,275.51	-14,185,863.73

### 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未计提减值准备。

**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
----	-----

	2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	4,210.75
预提审计费	14,918.54
预提信息披露费	259,672.34
合计	278,802.85

#### 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	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,416,932.14	73,416,932.14
本期申购	100,864,229.05	100,864,229.05
本期赎回（以“-”号填列）	-93,757,640.88	-93,757,640.88
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	80,523,520.31	80,523,520.31

##### 太平中证 1000 指数增强 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,723,771.31	42,723,771.31
本期申购	103,462,400.12	103,462,400.12
本期赎回（以“-”号填列）	-66,063,788.70	-66,063,788.70
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	80,122,382.73	80,122,382.73

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 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	5,352,604.72	-1,163,132.19	4,189,472.53
本期期初	5,352,604.72	-1,163,132.19	4,189,472.53
本期利润	-2,104,176.39	-8,378,163.01	-10,482,339.40
本期基金份额交易产生的变动数	-78,770.08	491,270.44	412,500.36
其中：基金申购款	5,323,220.92	-4,181,578.84	1,141,642.08
基金赎回款	-5,401,991.00	4,672,849.28	-729,141.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,169,658.25	-9,050,024.76	-5,880,366.51

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	2,805,236.07	-676,493.97	2,128,742.10
本期期初	2,805,236.07	-676,493.97	2,128,742.10
本期利润	-2,153,367.08	-5,513,306.68	-7,666,673.76
本期基金份额交易产生的变动数	1,784,668.35	-2,754,247.56	-969,579.21
其中：基金申购款	4,913,689.00	-6,304,306.05	-1,390,617.05
基金赎回款	-3,129,020.65	3,550,058.49	421,037.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,436,537.34	-8,944,048.21	-6,507,510.87

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	18,016.73
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,523.33
结算备付金利息收入	2,029.36
其他	64.58
合计	26,634.00

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.13 股票投资收益

6.4.7.13.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,977,159.86
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	-4,977,159.86

#### 6.4.7.13.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	980,808,729.07
减：卖出股票成本总额	984,699,841.01
减：交易费用	1,086,047.92
买卖股票差价收入	-4,977,159.86

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金在本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.14.3 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。

##### 6.4.7.14.4 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。

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.15.1 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。

##### 6.4.7.15.2 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。

##### 6.4.7.15.3 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。

##### 6.4.7.15.4 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。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

##### 6.4.7.16.1 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。

##### 6.4.7.16.2 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。

##### 6.4.7.16.3 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。

##### 6.4.7.16.4 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。

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

##### 6.4.7.17.1 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。

##### 6.4.7.17.2 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。

#### 6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,762,901.48
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	1,762,901.48

#### 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-13,891,469.69
股票投资	-13,891,469.69
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-13,891,469.69

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	107,736.28
基金转换费收入	4.32
合计	107,740.60

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.21 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	74,590.88

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
太平基金管理有限公司（“太平基金”）	基金管理人、基金销售机构、登记机构
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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	836,764.30	360,936.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	257,626.18	76,647.76
应支付基金管理人的净管理费	579,138.12	284,288.81

注：支付基金管理人太平基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1\% / \text{当年天数}。$$

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	125,514.70	54,140.45

注：支付基金托管人交通银行的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。其计算公式为：日托管费 = 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	40,577.80	40,577.80
交通银行	-	4,920.28	4,920.28
合计	-	45,498.08	45,498.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	29,336,006.26	36.4316	29,336,006.26	39.9581

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	2,433,756.30	18,016.73	4,055,154.62	15,921.37

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（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

###### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001389	广合	2024年3月	6个月	锁定期股	17.43	34.56	123	2,143.89	4,250.88	-

	科技	26 日		票						
301392	汇成真空	2024 年 5 月 28 日	6 个月	锁定期股票	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301539	宏鑫科技	2024 年 4 月 3 日	6 个月	锁定期股票	10.64	19.82	341	3,628.24	6,758.62	-
301565	中仑新材	2024 年 6 月 13 日	6 个月	锁定期股票	11.88	18.98	436	5,179.68	8,275.28	-
301587	中瑞股份	2024 年 3 月 27 日	6 个月	锁定期股票	21.73	25.26	159	3,455.07	4,016.34	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股未上市、锁定期股票	20.56	20.56	87	1,788.72	1,788.72	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月	锁定期股票	20.56	20.56	783	16,098.48	16,098.48	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	锁定期股票	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	锁定期股票	19.86	42.51	167	3,316.62	7,099.17	-

注：1. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2. 基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3. 基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自

发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 年 6 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具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2023 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末持有按长期信用评级列示的同业投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 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

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 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 2024 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货币资金、结算备付金和存出保证金。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,433,756.30	-	-	-	2,433,756.30
结算备付金	3,465.10	-	-	-	3,465.10
存出保证金	6,807,597.34	-	-	-	6,807,597.34
交易性金融资产	-	-	-	139,673,275.51	139,673,275.51
应收申购款	-	-	-	118,086.07	118,086.07
资产总计	9,244,818.74	-	-	139,791,361.58	149,036,180.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	321,503.47	321,503.47
应付管理人报酬	-	-	-	132,058.16	132,058.16
应付托管费	-	-	-	19,808.73	19,808.73
应付销售服务费	-	-	-	25,981.45	25,981.45
其他负债	-	-	-	278,802.85	278,802.85
负债总计	-	-	-	778,154.66	778,154.66
利率敏感度缺口	9,244,818.74	-	-	-139,013,206.92	148,258,025.66
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,422,164.22	-	-	-	8,422,164.22

结算备付金	900,716.71	-	-	-	900,716.71
存出保证金	43,998.77	-	-	-	43,998.77
交易性金融资产	-	-	-	111,560,590.81	111,560,590.81
应收申购款	-	-	-	3,703,999.17	3,703,999.17
资产总计	9,366,879.70	-	-	115,264,589.98	124,631,469.68
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	386,177.21	386,177.21
应付管理人报酬	-	-	-	92,741.72	92,741.72
应付托管费	-	-	-	13,911.26	13,911.26
应付清算款	-	-	-	1,328,869.97	1,328,869.97
应付销售服务费	-	-	-	12,854.82	12,854.82
其他负债	-	-	-	337,996.62	337,996.62
负债总计	-	-	-	2,172,551.60	2,172,551.60
利率敏感度缺口	9,366,879.70	-	-	-113,092,038.38	122,458,918.08

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2023 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	139,673,275.51	94.21	111,560,590.81	91.10
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	139,673,275.51	94.21	111,560,590.81	91.10

#### 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	10,088,018.37	2,843,282.69
	沪深 300 指数下降 5%	-10,088,018.37	-2,843,282.69

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	139,610,326.08	111,560,590.81
第二层次	17,887.20	-
第三层次	45,062.23	-
合计	139,673,275.51	111,560,590.81

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。  
 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上期末：同)。

**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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**§ 7 投资组合报告**

**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	139,673,275.51	93.72
	其中：股票	139,673,275.51	93.72
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	9,244,818.74	6.20
8	其他各项资产	118,086.07	0.08
9	合计	149,036,180.32	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	6,256,045.00	4.22
C	制造业	71,047,825.98	47.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,972,470.00	2.00
E	建筑业	3,692,610.00	2.49
F	批发和零售业	5,422,353.00	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	2,864,494.00	1.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,119,810.00	7.50
J	金融业	4,523,629.41	3.05
K	房地产业	2,085,794.00	1.41
L	租赁和商务服务业	1,781,164.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	756,028.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	771,714.00	0.52

R	文化、体育和娱乐业	3,326,226.00	2.24
S	综合	-	-
	合计	116,620,163.39	78.66

### 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	502,170.00	0.34
C	制造业	14,565,537.21	9.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,948,480.00	1.99
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,923,318.74	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	1,144,760.00	0.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,991.17	0.08
J	金融业	41,210.00	0.03
K	房地产业	1,067,562.00	0.72
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	736,083.00	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,053,112.12	15.55

### 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	000517	荣安地产	666,500	1,786,220.00	1.20
2	002100	天康生物	250,200	1,733,886.00	1.17
3	002948	青岛银行	493,500	1,663,095.00	1.12
4	600618	氯碱化工	179,700	1,577,766.00	1.06
5	300573	兴齐眼药	9,620	1,577,680.00	1.06
6	603766	隆鑫通用	229,600	1,556,688.00	1.05
7	600623	华谊集团	257,000	1,485,460.00	1.00
8	601369	陕鼓动力	180,000	1,443,600.00	0.97
9	002036	联创电子	212,800	1,436,400.00	0.97
10	600916	中国黄金	149,000	1,433,380.00	0.97
11	600602	云赛智联	129,300	1,427,472.00	0.96
12	601811	新华文轩	99,900	1,399,599.00	0.94
13	300182	捷成股份	375,300	1,392,363.00	0.94
14	603108	润达医疗	90,200	1,365,628.00	0.92
15	688128	中国电研	79,276	1,364,339.96	0.92
16	601869	长飞光纤	55,800	1,357,614.00	0.92
17	000810	创维数字	156,800	1,345,344.00	0.91
18	600123	兰花科创	149,700	1,339,815.00	0.90
19	002317	众生药业	117,200	1,339,596.00	0.90
20	002287	奇正藏药	68,400	1,339,272.00	0.90
21	002978	安宁股份	46,700	1,301,062.00	0.88
22	600835	上海机电	112,300	1,292,573.00	0.87
23	002461	珠江啤酒	173,040	1,283,956.80	0.87
24	002204	大连重工	298,300	1,273,741.00	0.86
25	002777	久远银海	84,600	1,268,154.00	0.86
26	002212	天融信	258,800	1,260,356.00	0.85
27	002237	恒邦股份	109,300	1,258,043.00	0.85
28	002911	佛燃能源	136,200	1,244,868.00	0.84
29	601068	中铝国际	292,300	1,230,583.00	0.83
30	002901	大博医疗	46,600	1,203,678.00	0.81
31	600812	华北制药	279,800	1,152,776.00	0.78
32	000030	富奥股份	233,600	1,146,976.00	0.77
33	688048	长光华芯	36,344	1,135,386.56	0.77
34	002643	万润股份	112,700	1,127,000.00	0.76
35	603132	金徽股份	81,200	1,117,312.00	0.75
36	300741	华宝股份	70,300	1,071,372.00	0.72
37	605222	起帆电缆	68,600	1,052,324.00	0.71
38	000034	神州数码	44,400	1,016,316.00	0.69
39	600012	皖通高速	72,700	1,015,619.00	0.69
40	002837	英维克	47,100	1,007,469.00	0.68
41	000582	北部湾港	134,700	1,002,168.00	0.68
42	300735	光弘科技	44,700	965,520.00	0.65
43	000682	东方电子	86,500	954,960.00	0.64

44	300045	华力创通	54,000	953,100.00	0.64
45	002378	章源钨业	163,700	939,638.00	0.63
46	600993	马应龙	34,900	930,783.00	0.63
47	300226	上海钢联	54,800	928,312.00	0.63
48	300229	拓尔思	69,100	928,013.00	0.63
49	000761	本钢板材	367,500	922,425.00	0.62
50	600577	精达股份	228,500	907,145.00	0.61
51	600562	国睿科技	65,900	900,194.00	0.61
52	300482	万孚生物	36,800	897,920.00	0.61
53	688007	光峰科技	54,928	884,340.80	0.60
54	300624	万兴科技	16,600	880,962.00	0.59
55	688076	诺泰生物	11,178	875,013.84	0.59
56	600877	电科芯片	81,100	869,392.00	0.59
57	000028	国药一致	26,900	866,987.00	0.58
58	000657	中钨高新	94,500	863,730.00	0.58
59	002183	怡亚通	300,300	852,852.00	0.58
60	601326	秦港股份	267,100	846,707.00	0.57
61	600933	爱柯迪	57,200	845,988.00	0.57
62	002222	福晶科技	37,400	842,622.00	0.57
63	000426	兴业银锡	61,800	839,244.00	0.57
64	300077	国民技术	95,900	837,207.00	0.56
65	002276	万马股份	116,500	835,305.00	0.56
66	000837	秦川机床	113,400	834,624.00	0.56
67	601101	昊华能源	88,800	816,072.00	0.55
68	300379	东方通	100,900	815,272.00	0.55
69	600110	诺德股份	267,100	814,655.00	0.55
70	000968	蓝焰控股	127,800	812,808.00	0.55
71	600667	太极实业	140,000	799,400.00	0.54
72	300451	创业慧康	229,300	793,378.00	0.54
73	000712	锦龙股份	105,200	789,000.00	0.53
74	000627	天茂集团	449,000	785,750.00	0.53
75	002585	双星新材	157,800	782,688.00	0.53
76	300821	东岳硅材	113,800	778,392.00	0.53
77	688209	英集芯	62,706	778,181.46	0.52
78	000016	深康佳 A	363,500	774,255.00	0.52
79	002219	新里程	414,900	771,714.00	0.52
80	002123	梦网科技	109,400	769,082.00	0.52
81	603693	江苏新能	66,100	768,082.00	0.52
82	600475	华光环能	86,800	756,028.00	0.51
83	002534	西子洁能	75,100	751,751.00	0.51
84	603915	国茂股份	72,400	744,996.00	0.50
85	600963	岳阳林纸	199,700	732,899.00	0.49
86	000951	中国重汽	50,900	728,888.00	0.49

87	002705	新宝股份	51,000	717,570.00	0.48
88	301205	联特科技	11,400	715,350.00	0.48
89	001236	弘业期货	100,500	714,555.00	0.48
90	600552	凯盛科技	75,300	710,079.00	0.48
91	000869	张裕 A	33,200	708,820.00	0.48
92	601279	英利汽车	187,900	700,867.00	0.47
93	300620	光库科技	18,700	687,786.00	0.46
94	003006	百亚股份	28,600	677,820.00	0.46
95	601886	江河集团	137,350	670,268.00	0.45
96	688321	微芯生物	37,836	665,913.60	0.45
97	688167	炬光科技	12,072	663,960.00	0.45
98	601778	晶科科技	289,200	659,376.00	0.44
99	600557	康缘药业	41,500	651,550.00	0.44
100	600810	神马股份	103,560	642,072.00	0.43
101	688380	中微半导	37,621	629,023.12	0.42
102	000917	电广传媒	123,800	625,190.00	0.42
103	601222	林洋能源	94,200	590,634.00	0.40
104	603983	丸美股份	21,300	586,389.00	0.40
105	000737	北方铜业	61,600	571,648.00	0.39
106	688586	江航装备	60,013	558,120.90	0.38
107	688183	生益电子	27,965	541,961.70	0.37
108	000498	山东路桥	103,300	540,259.00	0.36
109	601949	中国出版	90,400	534,264.00	0.36
110	002727	一心堂	35,200	531,168.00	0.36
111	002250	联化科技	107,400	515,520.00	0.35
112	002351	漫步者	38,700	508,905.00	0.34
113	002145	中核钛白	155,100	508,728.00	0.34
114	300369	绿盟科技	99,500	508,445.00	0.34
115	603169	兰石重装	111,900	503,550.00	0.34
116	601963	重庆银行	64,600	500,650.00	0.34
117	600556	天下秀	137,200	499,408.00	0.34
118	688556	高测股份	41,954	498,833.06	0.34
119	002163	海南发展	82,500	452,100.00	0.30
120	688388	嘉元科技	44,639	435,230.25	0.29
121	600458	时代新材	42,300	427,230.00	0.29
122	688177	百奥泰	16,586	350,296.32	0.24
123	300123	亚光科技	72,000	334,080.00	0.23
124	603013	亚普股份	24,400	328,668.00	0.22
125	000969	安泰科技	40,000	317,200.00	0.21
126	600903	贵州燃气	48,100	300,144.00	0.20
127	600266	城建发展	80,100	299,574.00	0.20
128	688110	东芯股份	15,523	296,023.61	0.20
129	002291	遥望科技	64,700	278,210.00	0.19

130	002318	久立特材	10,500	244,965.00	0.17
131	600335	国机汽车	36,200	208,874.00	0.14
132	603699	纽威股份	11,500	196,880.00	0.13
133	000403	派林生物	5,200	138,632.00	0.09
134	300034	钢研高纳	8,600	136,654.00	0.09
135	002851	麦格米特	5,100	131,784.00	0.09
136	002182	宝武镁业	11,600	130,848.00	0.09
137	600997	开滦股份	18,400	126,224.00	0.09
138	000555	神州信息	11,900	110,908.00	0.07
139	002292	奥飞娱乐	16,600	99,268.00	0.07
140	300080	易成新能	28,500	82,080.00	0.06
141	000567	海德股份	12,581	70,579.41	0.05
142	601011	宝泰隆	40,100	64,160.00	0.04
143	603197	保隆科技	1,500	47,250.00	0.03
144	600596	新安股份	3,300	25,080.00	0.02
145	601001	晋控煤业	1,300	21,476.00	0.01
146	600691	阳煤化工	8,800	15,048.00	0.01
147	002101	广东鸿图	1,000	10,530.00	0.01
148	600403	大有能源	3,200	8,256.00	0.01

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	600098	广州发展	239,900	1,535,360.00	1.04
2	000738	航发控制	64,600	1,296,522.00	0.87
3	603053	成都燃气	122,800	1,186,248.00	0.80
4	601512	中新集团	140,100	1,067,562.00	0.72
5	603680	今创集团	147,382	972,721.20	0.66
6	603511	爱慕股份	66,600	817,848.00	0.55
7	603585	苏利股份	83,600	815,936.00	0.55
8	600315	上海家化	45,300	805,434.00	0.54
9	601827	三峰环境	86,700	736,083.00	0.50
10	603235	天新药业	29,700	713,691.00	0.48
11	688055	龙腾光电	223,875	709,683.75	0.48
12	002399	海普瑞	81,300	704,871.00	0.48
13	301200	大族数控	22,300	703,788.00	0.47
14	000930	中粮科技	138,700	697,661.00	0.47
15	002678	珠江钢琴	188,900	683,818.00	0.46
16	002531	天顺风能	75,900	678,546.00	0.46
17	000553	安道麦 A	148,800	675,552.00	0.46
18	603233	大参林	46,500	664,950.00	0.45
19	002507	涪陵榨菜	47,200	578,200.00	0.39
20	002563	森马服饰	90,400	525,224.00	0.35
21	000039	中集集团	50,400	466,704.00	0.31

22	600981	汇鸿集团	274,600	464,074.00	0.31
23	001872	招商港口	23,200	446,600.00	0.30
24	600828	茂业商业	177,402	420,442.74	0.28
25	000636	风华高科	29,600	386,576.00	0.26
26	002120	韵达股份	49,000	379,260.00	0.26
27	601666	平煤股份	29,200	327,040.00	0.22
28	600548	深高速	30,000	318,900.00	0.22
29	000401	冀东水泥	73,000	296,380.00	0.20
30	600851	海欣股份	63,900	292,023.00	0.20
31	603676	卫信康	35,500	284,355.00	0.19
32	002636	金安国纪	40,700	258,445.00	0.17
33	300595	欧普康视	14,700	230,496.00	0.16
34	603689	皖天然气	27,600	226,872.00	0.15
35	600549	厦门钨业	11,100	191,475.00	0.13
36	603883	老百姓	10,200	187,272.00	0.13
37	603939	益丰药房	7,600	186,580.00	0.13
38	002128	电投能源	8,300	175,130.00	0.12
39	603712	七一二	9,100	165,529.00	0.11
40	605339	南侨食品	10,000	142,200.00	0.10
41	002153	石基信息	20,400	116,892.00	0.08
42	605338	巴比食品	7,700	102,025.00	0.07
43	002950	奥美医疗	14,200	93,720.00	0.06
44	601877	正泰电器	4,500	85,770.00	0.06
45	603095	越剑智能	5,100	66,861.00	0.05
46	601818	光大银行	13,000	41,210.00	0.03
47	002372	伟星新材	2,600	40,092.00	0.03
48	603350	安乃达	870	17,887.20	0.01
49	603515	欧普照明	800	13,872.00	0.01
50	002436	兴森科技	900	9,288.00	0.01
51	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
52	301565	中仑新材	436	8,275.28	0.01
53	688691	灿芯股份	167	7,099.17	0.00
54	301539	宏鑫科技	341	6,758.62	0.00
55	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
56	603618	杭电股份	1,000	4,380.00	0.00
57	001389	广合科技	123	4,250.88	0.00
58	301587	中瑞股份	159	4,016.34	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002036	联创电子	5,607,789.00	4.58

2	002183	怡亚通	5,095,740.00	4.16
3	002332	仙琚制药	4,908,492.00	4.01
4	002891	中宠股份	4,856,718.00	3.97
5	600338	西藏珠峰	4,770,400.00	3.90
6	688110	东芯股份	4,748,822.24	3.88
7	600667	太极实业	4,697,884.66	3.84
8	300451	创业慧康	4,677,508.00	3.82
9	688166	博瑞医药	4,666,337.29	3.81
10	601869	长飞光纤	4,609,556.00	3.76
11	000028	国药一致	4,579,960.00	3.74
12	300482	万孚生物	4,574,260.00	3.74
13	601369	陕鼓动力	4,542,711.00	3.71
14	688007	光峰科技	4,493,886.59	3.67
15	000762	西藏矿业	4,478,066.00	3.66
16	000682	东方电子	4,430,734.00	3.62
17	002705	新宝股份	4,404,766.00	3.60
18	002041	登海种业	4,399,677.00	3.59
19	600711	盛屯矿业	4,396,022.00	3.59
20	600012	皖通高速	4,323,184.00	3.53
21	601126	四方股份	4,238,305.00	3.46
22	300567	精测电子	4,034,062.00	3.29
23	002204	大连重工	3,991,823.00	3.26
24	300379	东方通	3,988,558.00	3.26
25	002585	双星新材	3,965,693.00	3.24
26	600777	ST 新潮	3,895,440.00	3.18
27	600926	杭州银行	3,889,896.00	3.18
28	000951	中国重汽	3,873,309.00	3.16
29	603005	晶方科技	3,777,412.00	3.08
30	688083	中望软件	3,766,254.18	3.08
31	600098	广州发展	3,729,272.00	3.05
32	600602	云赛智联	3,712,156.00	3.03
33	600559	老白干酒	3,710,333.00	3.03
34	300294	博雅生物	3,672,199.00	3.00
35	603087	甘李药业	3,647,251.00	2.98
36	601952	苏垦农发	3,569,630.70	2.91
37	002378	章源钨业	3,548,693.30	2.90
38	300655	晶瑞电材	3,524,440.00	2.88
39	603920	世运电路	3,464,497.06	2.83
40	002145	中核钛白	3,452,008.00	2.82
41	300432	富临精工	3,445,136.00	2.81
42	601068	中铝国际	3,404,227.00	2.78
43	600872	中炬高新	3,317,103.00	2.71
44	000860	顺鑫农业	3,298,347.00	2.69

45	300456	赛微电子	3,289,739.00	2.69
46	002061	浙江交科	3,270,636.00	2.67
47	002948	青岛银行	3,260,028.00	2.66
48	002488	金固股份	3,250,229.00	2.65
49	002100	天康生物	3,231,870.00	2.64
50	300034	钢研高纳	3,226,814.00	2.64
51	000030	富奥股份	3,211,197.00	2.62
52	603595	东尼电子	3,193,496.00	2.61
53	300496	中科创达	3,178,524.00	2.60
54	002038	双鹭药业	3,137,572.00	2.56
55	688185	康希诺	3,121,228.63	2.55
56	000517	荣安地产	3,114,482.00	2.54
57	300459	汤姆猫	3,110,577.00	2.54
58	002901	大博医疗	3,103,265.00	2.53
59	600710	苏美达	3,098,537.00	2.53
60	601019	山东出版	3,090,659.00	2.52
61	300633	开立医疗	3,090,161.00	2.52
62	600927	永安期货	3,059,641.72	2.50
63	000627	天茂集团	3,056,958.00	2.50
64	603766	隆鑫通用	3,048,699.00	2.49
65	002317	众生药业	3,028,764.00	2.47
66	000738	航发控制	2,998,747.00	2.45
67	000059	华锦股份	2,998,488.00	2.45
68	002906	华阳集团	2,979,105.00	2.43
69	002837	英维克	2,977,983.00	2.43
70	300666	江丰电子	2,953,445.00	2.41
71	300458	全志科技	2,947,104.00	2.41
72	300229	拓尔思	2,933,193.00	2.40
73	600764	中国海防	2,921,993.00	2.39
74	603025	大豪科技	2,911,633.00	2.38
75	300226	上海钢联	2,902,380.00	2.37
76	300142	沃森生物	2,895,417.20	2.36
77	002678	珠江钢琴	2,878,843.00	2.35
78	300166	东方国信	2,877,490.00	2.35
79	002351	漫步者	2,866,637.00	2.34
80	000039	中集集团	2,847,758.00	2.33
81	002245	蔚蓝锂芯	2,842,710.00	2.32
82	603678	火炬电子	2,821,184.00	2.30
83	002226	江南化工	2,819,785.00	2.30
84	002153	石基信息	2,814,926.00	2.30
85	600217	中再资环	2,807,618.00	2.29
86	600123	兰花科创	2,799,009.40	2.29
87	601001	晋控煤业	2,795,369.00	2.28

88	002777	久远银海	2,785,487.00	2.27
89	601077	渝农商行	2,775,720.00	2.27
90	601969	海南矿业	2,750,574.00	2.25
91	688180	君实生物	2,726,342.75	2.23
92	300101	振芯科技	2,723,724.00	2.22
93	603123	翠微股份	2,694,287.00	2.20
94	002254	泰和新材	2,688,620.00	2.20
95	600556	天下秀	2,682,278.00	2.19
96	688128	中国电研	2,664,692.24	2.18
97	600801	华新水泥	2,605,889.00	2.13
98	600335	国机汽车	2,597,979.00	2.12
99	002911	佛燃能源	2,594,259.40	2.12
100	000927	中国铁物	2,567,744.00	2.10
101	600835	上海机电	2,567,553.00	2.10
102	603229	奥翔药业	2,563,427.00	2.09
103	603919	金徽酒	2,553,513.00	2.09
104	603132	金徽股份	2,553,349.00	2.09
105	600933	爱柯迪	2,553,296.00	2.09
106	600770	综艺股份	2,552,602.00	2.08
107	603680	今创集团	2,533,203.94	2.07
108	601965	中国汽研	2,519,459.00	2.06
109	000718	苏宁环球	2,509,025.00	2.05
110	002549	凯美特气	2,506,360.00	2.05
111	601333	广深铁路	2,499,320.00	2.04
112	002389	航天彩虹	2,486,377.00	2.03
113	002643	万润股份	2,482,045.00	2.03
114	300624	万兴科技	2,474,091.00	2.02
115	603053	成都燃气	2,456,556.00	2.01
116	688050	爱博医疗	2,453,083.98	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	002891	中宠股份	5,554,283.00	4.54
2	601126	四方股份	5,531,278.00	4.52
3	688166	博瑞医药	5,528,118.03	4.51
4	600338	西藏珠峰	5,053,974.00	4.13
5	002332	仙琚制药	4,899,916.00	4.00
6	000028	国药一致	4,684,341.80	3.83
7	600012	皖通高速	4,587,727.00	3.75
8	000762	西藏矿业	4,582,676.00	3.74
9	688110	东芯股份	4,570,811.76	3.73

10	688083	中望软件	4,562,601.54	3.73
11	600872	中炬高新	4,548,501.00	3.71
12	002705	新宝股份	4,527,582.00	3.70
13	300567	精测电子	4,458,946.00	3.64
14	002041	登海种业	4,322,973.00	3.53
15	002036	联创电子	4,255,530.00	3.48
16	601019	山东出版	4,240,024.00	3.46
17	002183	怡亚通	4,228,847.67	3.45
18	601001	晋控煤业	4,093,942.00	3.34
19	600711	盛屯矿业	4,080,800.00	3.33
20	603920	世运电路	4,069,556.00	3.32
21	603087	甘李药业	4,025,575.00	3.29
22	600667	太极实业	3,993,254.95	3.26
23	600710	苏美达	3,970,832.00	3.24
24	603005	晶方科技	3,954,641.00	3.23
25	601369	陕鼓动力	3,916,721.00	3.20
26	600926	杭州银行	3,869,311.00	3.16
27	300655	晶瑞电材	3,764,277.00	3.07
28	600559	老白干酒	3,701,032.00	3.02
29	300458	全志科技	3,688,168.00	3.01
30	000682	东方电子	3,657,596.00	2.99
31	000860	顺鑫农业	3,645,992.00	2.98
32	300294	博雅生物	3,621,108.00	2.96
33	601952	苏垦农发	3,609,800.90	2.95
34	601969	海南矿业	3,573,591.00	2.92
35	300432	富临精工	3,523,101.92	2.88
36	688007	光峰科技	3,490,699.68	2.85
37	300451	创业慧康	3,475,055.00	2.84
38	300034	钢研高纳	3,433,077.00	2.80
39	300482	万孚生物	3,430,044.00	2.80
40	002061	浙江交科	3,377,665.00	2.76
41	002906	华阳集团	3,370,543.00	2.75
42	300496	中科创达	3,333,736.00	2.72
43	002585	双星新材	3,313,752.00	2.71
44	600777	ST 新潮	3,293,873.23	2.69
45	300666	江丰电子	3,261,899.00	2.66
46	601869	长飞光纤	3,229,038.00	2.64
47	300633	开立医疗	3,226,890.00	2.64
48	600602	云赛智联	3,193,414.00	2.61
49	001213	中铁特货	3,158,831.00	2.58
50	002245	蔚蓝锂芯	3,151,087.00	2.57
51	603556	海兴电力	3,107,368.60	2.54
52	600927	永安期货	3,087,051.20	2.52

53	000059	华锦股份	3,085,664.00	2.52
54	002378	章源钨业	3,064,717.80	2.50
55	002488	金固股份	3,056,511.00	2.50
56	000902	新洋丰	3,056,288.00	2.50
57	300459	汤姆猫	3,052,879.00	2.49
58	002038	双鹭药业	3,046,070.00	2.49
59	603025	大豪科技	3,030,205.40	2.47
60	300456	赛微电子	3,027,516.00	2.47
61	600483	福能股份	3,009,266.60	2.46
62	000951	中国重汽	3,001,227.80	2.45
63	688185	康希诺	2,999,417.93	2.45
64	601077	渝农商行	2,959,918.00	2.42
65	300166	东方国信	2,959,262.00	2.42
66	603678	火炬电子	2,920,588.53	2.38
67	600764	中国海防	2,889,291.00	2.36
68	300101	振芯科技	2,880,651.00	2.35
69	002145	中核钛白	2,872,984.00	2.35
70	600645	中源协和	2,870,725.00	2.34
71	603595	东尼电子	2,866,274.00	2.34
72	000928	中钢国际	2,847,494.36	2.33
73	600801	华新水泥	2,840,141.00	2.32
74	000932	华菱钢铁	2,820,079.00	2.30
75	002226	江南化工	2,819,769.00	2.30
76	603919	金徽酒	2,782,462.00	2.27
77	002389	航天彩虹	2,729,609.00	2.23
78	002961	瑞达期货	2,725,564.00	2.23
79	600217	中再资环	2,718,479.00	2.22
80	300142	沃森生物	2,705,019.00	2.21
81	603112	华翔股份	2,702,466.40	2.21
82	603229	奥翔药业	2,635,000.12	2.15
83	000681	视觉中国	2,634,649.00	2.15
84	688180	君实生物	2,629,483.10	2.15
85	002254	泰和新材	2,623,616.00	2.14
86	000030	富奥股份	2,607,839.40	2.13
87	601333	广深铁路	2,601,992.00	2.12
88	002204	大连重工	2,600,642.00	2.12
89	600266	城建发展	2,591,183.00	2.12
90	300075	数字政通	2,583,009.20	2.11
91	002549	凯美特气	2,575,199.28	2.10
92	601965	中国汽研	2,565,264.00	2.09
93	300765	新诺威	2,559,122.80	2.09
94	000552	甘肃能化	2,531,144.00	2.07
95	688050	爱博医疗	2,528,363.42	2.06

96	000019	深粮控股	2,527,341.93	2.06
97	000039	中集集团	2,521,785.00	2.06
98	300379	东方通	2,509,548.00	2.05
99	000718	苏宁环球	2,507,123.00	2.05
100	603766	隆鑫通用	2,494,556.00	2.04
101	603123	翠微股份	2,476,505.00	2.02
102	300679	电连技术	2,465,419.00	2.01
103	002913	奥士康	2,464,242.00	2.01
104	600691	阳煤化工	2,461,150.00	2.01
105	002410	广联达	2,460,822.00	2.01
106	000927	中国铁物	2,457,315.00	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	1,026,703,995.40
卖出股票收入（成交）总额	980,808,729.07

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中，青岛银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	118,086.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	118,086.07

#### 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	4,426	18,193.29	33,238,573.54	41.2781	47,284,946.77	58.7219
太平中证 1000 指数增强 C	2,282	35,110.60	31,746,372.48	39.6224	48,376,010.25	60.3776
合计	6,625	24,248.44	64,984,946.02	40.4523	95,660,957.02	59.5477

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	4,823,009.36	5.9896
	太平中证 1000 指数增强 C	97,149.34	0.1213
	合计	4,920,158.70	3.0627

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研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

## § 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	73,416,932.14	42,723,771.31
本报告期基金总申购份额	100,864,229.05	103,462,400.12
减:本报告期基金总赎回份额	93,757,640.88	66,063,788.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	80,523,520.31	80,122,382.73

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

### 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 (%)	
国投证券	2	1,856,234,413.04	92.48	-	-	-
天风证券	2	151,023,691.59	7.52	28,937.77	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) 公司信誉及财务状况良好，经营状况稳定。最近一年未出现亏损或审计机构无法出具无保留意见的审计报告等情形；

(2) 经营行为规范。最近一年未因重大违规行为而受到监管部门处罚；

(3) 合规风控能力较强。内部管理规范、严格，具备健全的内控和风险控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。最近一年证监会对证券公司分类结果为 BB 类以上（含）；

(4) 交易服务能力较强。具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需。重点参考最近一个年度券商交易量市场排名；

(5) 研究服务能力较强。设置固定的研究机构，拥有专业的研究人员，能够及时全面地提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他信息服务等。

(6) 与公司签订综合服务协议。

基金管理人的总经理办公会根据上述标准确定可以合作的券商名单，由投资决策委员会在上述名单内确定租用的交易单元，并签订交易单元租用协议。

#### 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国投证券 2 个交易单元。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
国投证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本期未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加招商银行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	2024 年 1 月 18 日
2	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
3	关于太平中证 1000 指数增强型证券投资基金证券交易结算模式转换并修改托管协议的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 29 日
4	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	2024 年 1 月 31 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	2024 年 1 月 31 日
6	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 31 日
7	关于太平中证 1000 指数增强型证券投资基金证券交易结算模式转换完成的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 31 日
8	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书(更新)(2024 年第 1 号)	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 31 日
9	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券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	2024 年 3 月 13 日
10	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 30 日
11	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	2024 年 4 月 20 日
12	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	2024 年 4 月 20 日
13	太平中证 1000 指数增强型证券投资	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 20 日

	基金招募说明书(更新)(2024年第2号)		
14	太平中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
15	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	2024 年 6 月 28 日
16	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	2024 年 6 月 28 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101 - 20240128	29,336,006.26	-	-	29,336,006.26	18.2613
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，503A）

## 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](http://www.taipingfund.com.cn)

太平基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日