

天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2023 年 08 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08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日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	89
7.1 期末基金资产组合情况	89
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	89
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	91
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	98
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	100
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	100
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	100
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	101
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	101
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	101
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	101
7.12 投资组合报告附注	101
§8 基金份额持有人信息	102
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	102
8.2 期末上市基金前十名持有人	103

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	103
8.4 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.....	103
§9 开放式基金份额变动.....	104
§10 重大事件揭示.....	104
10.1 基金份额持有人大会决议.....	104
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.....	104
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	104
10.4 基金投资策略的改变.....	104
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	105
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.....	105
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	105
10.8 其他重大事件.....	106
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	108
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.....	108
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	108
§12 备查文件目录.....	109
12.1 备查文件目录.....	109
12.2 存放地点.....	109
12.3 查阅方式.....	109

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘中证食品饮料ETF
场内简称	饮食ETF
基金主代码	159736
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年09月09日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,371,894,457.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021年09月27日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份

	股相关的衍生工具。主要产品投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等策略。
业绩比较基准	中证食品饮料指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。

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		天弘基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	杨军智
	联系电话	022-83310208	010-60834299
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		95046	010-60836588
传真		022-83865564	010-60834004
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码		300203	100125
法定代表人		韩歆毅	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.thfund.com.cn

址	
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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01月01日- 2023年06月30日)	
	本期已实现收益	-32,069,076.33
本期利润	-597,851,465.77	
加权平均基金份额本期利润	-0.0914	
本期加权平均净值利润率	-9.77%	
本期基金份额净值增长率	-10.97%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
	期末可供分配利润	-1,022,237,067.94
	期末可供分配基金份额利润	-0.1604
	期末基金资产净值	5,349,657,389.06
	期末基金份额净值	0.8396
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	-16.04%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润为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。

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

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	0.26%	1.37%	-0.95%	1.37%	1.21%	0.00%
过去三个月	-13.93%	1.18%	-15.12%	1.18%	1.19%	0.00%
过去六个月	-10.97%	1.25%	-12.13%	1.26%	1.16%	-0.01%
过去一年	-19.85%	1.47%	-20.97%	1.47%	1.12%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-16.04%	1.57%	-16.04%	1.60%	0.00%	-0.03%

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

天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年09月09日-2023年06月30日)



- 注：1、本基金合同于2021年09月09日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2023年6月30日，公司共管理运作180只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

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		
沙川	本基金基金经理	2021年09月	-	12年	男，数学硕士。历任中国中投证券有限责任公司金融工程助理分析师。2013年9月加盟本公司，历任研究员。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从《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》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易次数为3次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

本基金在2023年上半年按照基金合同约定采用完全复制的投资策略来控制跟踪误差，并力争在跟踪误差允许范围内获取更多收益。

期间基金整体运行平稳，日均跟踪偏离和年化跟踪误差均控制在合理范围内。日均跟踪偏离和跟踪误差主要来自基金每日的申购赎回导致的基金仓位变化，指数成分股分红，以及持有的新股上市后涨幅与基准指数涨幅的差异。同时，本基金参与了转融通证券出借业务，以获得出借证券的利息收入；参与了新股申购业务，不过由于近期新股上市后涨幅变小甚至破发，新股贡献的收益明显下降。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年06月30日，本基金份额净值为0.8396元，本报告期份额净值增长率-10.97%，同期业绩比较基准增长率-12.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于去年底防疫政策调整，股票市场对今年经济复苏期待较高，所以今年初A股市场表现较好。但随着地产复苏低于预期，以及政策定力超预期，股票市场开始震荡并走低。

对于下半年的中国经济，我认为仍有一定压力。一是海外高利率环境，导致全球经济有较大衰退风险，外需下降将影响出口；二是中美贸易摩擦延续，脱钩断链会影响国内的投资；三是经济的悲观预期可能带来消费和房地产上的自我实现。但相应的，预期会有较大力度的刺激政策出台。所以，对于下半年A股市场，不必太过悲观。

国内消费意愿恢复较好，但实际消费恢复有限，主要还是对于经济不确定的担忧。消费信心的提升，滞后于经济的恢复和企业利润的好转，预计在4季度才会体现，而A股市场也许会提前反应。所以，我对下半年食品饮料行业表现的判断，是以震荡为主，如果有较大刺激出台，会有阶段性表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，天弘基金管理有限公司在天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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，由天弘基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天弘中证食品饮料交易型开放式指数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：天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,565,830.80	5,881,410.96
结算备付金		499,461.74	62,870.16
存出保证金		799,085.00	832,781.54
交易性金融资产	6.4.7.2	5,346,236,194.00	6,920,794,951.25
其中：股票投资		5,345,494,140.33	6,920,794,951.25
基金投资		-	-
债券投资		742,053.67	-
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	1,536,327.03
应收股利		4,986.90	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	121,099.31	120,080.26
资产总计		5,365,226,657.75	6,929,228,421.20
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		12,500,564.38	1,079,285.32
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,230,301.12	2,978,550.85
应付托管费		446,060.20	595,710.16
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		27,082.55	4,075.89

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	365,260.44	887,313.05
负债合计		15,569,268.69	5,544,935.27
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	6,371,894,457.00	7,342,394,457.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-1,022,237,067.94	-418,710,971.07
净资产合计		5,349,657,389.06	6,923,683,485.93
负债和净资产总计		5,365,226,657.75	6,929,228,421.20

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值0.8396元，基金份额总额6,371,894,457.00份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		-579,368,114.00	-298,593,871.84
1.利息收入		2,439,009.11	469,394.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	88,240.48	151,109.35
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		2,350,768.63	318,285.37
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-16,651,712.26	-152,781,422.33

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-97,079,112.30	-245,986,422.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	367,077.71	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	80,060,322.33	93,204,999.78
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）	6.4.7.16	-565,782,389.44	-152,360,280.57
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	626,978.59	6,078,436.34
减：二、营业总支出		18,483,351.77	21,924,613.09
1. 管理人报酬		15,239,013.14	18,115,612.65
2. 托管费		3,047,802.58	3,623,122.55
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		13,058.16	2,400.00
8. 其他费用	6.4.7.19	183,477.89	183,477.89
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-597,851,465.77	-320,518,484.93
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-597,851,465.77	-320,518,484.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-597,851,465.77	-320,518,484.93

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06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）	7,342,394,457.00	-	-418,710,971.07	6,923,683,485.93
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）	7,342,394,457.00	-	-418,710,971.07	6,923,683,485.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-970,500,000.00	-	-603,526,096.87	-1,574,026,096.87
（一）、综合收益总额	-	-	-597,851,465.77	-597,851,465.77
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	-970,500,000.00	-	-5,674,631.10	-976,174,631.10

少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	297,000,000.00	-	-31,797,137.68	265,202,862.32
2.基金赎回款	-1,267,500,000.00	-	26,122,506.58	-1,241,377,493.42
(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)	6,371,894,457.00	-	-1,022,237,067.94	5,349,657,389.06
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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)	6,769,394,457.00	-	698,660,299.41	7,468,054,756.41
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)	6,769,394,457.00	-	698,660,299.41	7,468,054,756.41
三、本期增减变	811,500,000.00	-	-338,630,102.43	472,869,897.57

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-320,518,484.93	-320,518,484.93
（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）	811,500,000.00	-	-18,111,617.50	793,388,382.50
其中：1.基金申购款	2,367,000,000.00	-	-116,799,967.85	2,250,200,032.15
2.基金赎回款	-1,555,500,000.00	-	98,688,350.35	-1,456,811,649.65
（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）	7,580,894,457.00	-	360,030,196.98	7,940,924,653.98

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：

韩歆毅（代）

薄贺龙

薄贺龙

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

天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金(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[2021]1447号《关于准予天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘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《天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,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326,881,550.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0897号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2021年9月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为326,894,457.00份基金份额,其中认购资金利息折合12,907.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]925号文审核同意,本基金326,894,457.00份基金份额于2021年9月27日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且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合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证食品饮料指数收益率。

本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司以本基金为目标ETF,将原天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金转型为天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投

资基金联接基金(以下简称“天弘中证食品饮料联接基金”)。天弘中证食品饮料联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况以及2023年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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]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。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	17,565,830.80
等于：本金	17,558,842.33
加：应计利息	6,988.47
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	17,565,830.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	6,584,117,115.88	-	5,345,494,140.33	-1,238,622,975.55	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	742,000.00	53.67	742,053.67	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	742,000.00	53.67	742,053.67	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	6,584,859,115.88	53.67	5,346,236,194.00	-1,238,622,975.55	

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应收利息	-
其他应收款	45,483.07
待摊费用	75,616.24
合计	121,099.31

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	236,166.31
其中：交易所市场	236,166.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	129,094.13
合计	365,260.44

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期

	2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,342,394,457.00	7,342,394,457.00
本期申购	297,000,000.00	297,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,267,500,000.00	-1,267,500,000.00
本期末	6,371,894,457.00	6,371,894,457.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	291,911,801.76	-710,622,772.83	-418,710,971.07
本期利润	-32,069,076.33	-565,782,389.44	-597,851,465.77
本期基金份额交易产生的变动数	-35,110,185.96	29,435,554.86	-5,674,631.10
其中：基金申购款	9,501,628.39	-41,298,766.07	-31,797,137.68
基金赎回款	-44,611,814.35	70,734,320.93	26,122,506.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	224,732,539.47	-1,246,969,607.41	-1,022,237,067.94

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	62,296.25
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	18,831.13
其他	7,113.10
合计	88,240.48

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-81,672,443.21
股票投资收益——赎回差价收入	-15,406,669.09
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	-97,079,112.30

6.4.7.10.2 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01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	968,936,181.73
减：卖出股票成本总额	1,048,973,280.98
减：交易费用	1,635,343.96
买卖股票差价收入	-81,672,443.21

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
赎回基金份额对价总额	1,241,377,493.42
减：现金支付赎回款总额	728,429,245.42
减：赎回股票成本总额	528,354,917.09
减：交易费用	-
赎回差价收入	-15,406,669.09

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	207.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	366,869.82
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	367,077.71

6.4.7.11.2 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01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,383,085.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,016,000.00
减：应计利息总额	160.33
减：交易费用	55.25
买卖债券差价收入	366,869.82

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	80,060,322.33
其中：证券出借权益补偿收入	1,276,209.24
基金投资产生的股利收益	-
合计	80,060,322.33

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-565,782,389.44
——股票投资	-565,782,389.44
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-565,782,389.44

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
----	-------------------------------

基金赎回费收入	-
基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	626,978.59
延期合约递延费收入	-
合计	626,978.59

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	49,588.57
证券出借违约金	-
IOPV计算发布费	9,916.99
ETF登记结算费	74,383.76
合计	183,477.89

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

截至本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
-------	---------

天弘基金管理有限公司	基金管理人
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券股份有限公司	316,972,021.85	22.48%	2,183,288,685.05	71.88%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	78,824.36	14.33%	78,777.69	33.36%

股份有限公司				
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券股份有限公司	941,699.51	71.88%	539,401.02	63.83%

注: 1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定, 以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,239,013.14	18,115,612.65
其中: 支付销售机构的客户维护费	51,311.28	2,201.96

注: 1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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: 日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费, 用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用, 该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支, 不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,047,802.58	3,623,122.55

注:支付基金托管人中信证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×该日适用费率/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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过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

单位:人民币元

本期 2023年01月01日至2023年06月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券股份有限公司	966,022,707.00	624,036.13	-	-
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券股份有限公司	150,462,259.00	74,333.21	63,709,532.00	15,996.05

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

单位:人民币元

本期 2023年01月01日至2023年06月30日										
关联方	合约编	证券名	成交时	交易金	交易数	出借期	费率	利息收	期末证	期末应

名称	号	称	间	额	量(股)	限(天)		入	券出借 业务余 额	收利息 余额
中信证 券股份 有限公 司	202301 030002 8811	DR 嘉必 优	2023-0 1-03	225,79 2.00	4,900	14	3.20%	272.81	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 030002 8813	三元生 物	2023-0 1-03	194,85 0.00	5,000	14	3.20%	235.42	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 030002 8821	金龙鱼	2023-0 1-03	2,062, 574.00	47,900	14	3.20%	2,492. 00	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 030002 8909	汤臣倍 健	2023-0 1-03	1,859, 130.00	81,900	14	3.20%	2,246. 19	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 030002 8935	立高食 品	2023-0 1-03	522,44 5.00	5,500	14	3.20%	631.21	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 030002 8937	华宝股 份	2023-0 1-03	238,82 6.00	9,800	14	3.20%	288.55	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 030002 8941	新诺威	2023-0 1-03	240,63 5.00	14,900	14	3.20%	290.74	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 030003 0135	DR 嘉必 优	2023-0 1-03	1,976, 832.00	42,900	14	3.40%	2,537. 68	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 060000 1245	华宝股 份	2023-0 1-06	58,00 8.00	2,400	14	3.40%	74.47	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 060000 9290	新诺威	2023-0 1-06	1,328, 352.00	82,200	14	3.40%	1,705. 22	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 090000 2150	华宝股 份	2023-0 1-09	1,999, 848.00	82,400	14	3.40%	3,850. 84	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 130000 0733	金龙鱼	2023-0 1-13	287,65 8.00	6,300	14	3.40%	448.40	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 170002 7469	新诺威	2023-0 1-17	249,57 5.00	14,900	14	3.20%	301.53	-	-

中信证券股份有限公司	202301 170002 7479	汤臣倍健	2023-0 1-17	1,945, 125.00	81,900	14	3.20%	2,350. 10	-	-
中信证券股份有限公司	202301 170002 7587	金龙鱼	2023-0 1-17	2,206, 753.00	47,900	14	3.20%	2,666. 19	-	-
中信证券股份有限公司	202301 170002 7591	DR 嘉必优	2023-0 1-17	254,31 0.00	4,900	14	3.20%	307.25	-	-
中信证券股份有限公司	202301 170002 7607	立高食品	2023-0 1-17	534,93 0.00	5,500	14	3.20%	646.30	-	-
中信证券股份有限公司	202301 170002 7611	华宝股份	2023-0 1-17	237,06 2.00	9,800	14	3.20%	286.42	-	-
中信证券股份有限公司	202301 170002 7615	三元生物	2023-0 1-17	179,90 0.00	5,000	14	3.20%	217.36	-	-
中信证券股份有限公司	202301 180000 0479	DR 嘉必优	2023-0 1-18	2,140, 380.00	41,400	14	3.40%	2,747. 63	-	-
中信证券股份有限公司	202301 190000 1177	新诺威	2023-0 1-19	123,73 5.00	7,300	14	3.40%	158.84	-	-
中信证券股份有限公司	202301 200000 0728	新诺威	2023-0 1-20	619,27 2.00	36,600	14	3.40%	794.97	-	-
中信证券股份有限公司	202301 200000 0730	金龙鱼	2023-0 1-20	276,87 9.00	6,100	14	3.40%	355.44	-	-
中信证券股份有限公司	202301 200000 7329	新诺威	2023-0 1-20	1,390, 824.00	82,200	14	3.40%	1,785. 42	-	-
中信证券股份有限公司	202301 300006 9351	金龙鱼	2023-0 1-30	285,51 6.00	6,300	14	3.40%	366.52	-	-
中信证券股份有限公司	202301 310002 7589	立高食品	2023-0 1-31	491,42 5.00	5,500	14	3.20%	593.74	-	-
中信证券股份有限公司	202301 310002 7645	新诺威	2023-0 1-31	253,44 9.00	14,900	14	3.20%	306.21	-	-

司										
中信证 券股份 有限公 司	202301 310002 7653	DR 嘉必 优	2023-0 1-31	243,92 2.00	4,900	14	3.20%	294.71	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 310002 7677	金龙鱼	2023-0 1-31	2,141, 609.00	47,900	14	3.20%	2,587. 49	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 310003 1787	汤臣倍 健	2023-0 1-31	1,888, 614.00	81,900	14	3.20%	2,281. 83	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 310003 1893	华宝股 份	2023-0 1-31	240,68 8.00	9,800	14	3.20%	290.80	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202301 310003 1895	三元生 物	2023-0 1-31	183,45 0.00	5,000	14	3.20%	221.64	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202302 010001 8548	DR 嘉必 优	2023-0 2-01	2,115, 540.00	41,400	14	3.40%	2,715. 74	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202302 030000 1169	华宝股 份	2023-0 2-03	49,48 0.00	2,000	14	3.40%	63.51	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202302 030000 1172	新诺威	2023-0 2-03	66,65 1.00	3,900	14	3.40%	85.56	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202302 060000 1246	金龙鱼	2023-0 2-06	44,27 0.00	1,000	14	3.40%	56.83	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202302 060000 1248	新诺威	2023-0 2-06	2,019, 600.00	118,80 0	14	3.40%	2,592. 58	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202302 100000 2285	欢乐家	2023-0 2-10	20,48 0.00	1,600	14	3.40%	26.29	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202302 100000 2286	金龙鱼	2023-0 2-10	128,47 0.00	2,900	14	3.40%	164.92	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202302 130006 6740	金龙鱼	2023-0 2-13	286,20 9.00	6,300	14	3.40%	367.41	-	-
中信证 券股份	202302 140002	华宝股 份	2023-0 2-14	252,05 6.00	9,800	14	3.20%	304.53	-	-

有限公司	2065									
中信证券股份有限公司	202302 140002 2643	金龙鱼	2023-0 2-14	2,171, 786.00	47,900	14	3.20%	2,623. 95	-	-
中信证券股份有限公司	202302 140002 2647	三元生物	2023-0 2-14	187,05 0.00	5,000	14	3.20%	225.99	-	-
中信证券股份有限公司	202302 140002 2699	立高食品	2023-0 2-14	538,39 5.00	5,500	14	3.20%	650.49	-	-
中信证券股份有限公司	202302 140002 5077	DR 嘉必优	2023-0 2-14	257,25 0.00	4,900	14	3.20%	310.81	-	-
中信证券股份有限公司	202302 140002 7391	汤臣倍健	2023-0 2-14	1,884, 519.00	81,900	14	3.20%	2,276. 87	-	-
中信证券股份有限公司	202302 140002 7407	新诺威	2023-0 2-14	262,24 0.00	14,900	14	3.20%	316.84	-	-
中信证券股份有限公司	202302 150001 8492	DR 嘉必优	2023-0 2-15	2,187, 576.00	41,400	14	3.40%	2,808. 21	-	-
中信证券股份有限公司	202302 160000 1610	三元生物	2023-0 2-16	744,60 4.00	20,300	14	3.40%	955.85	-	-
中信证券股份有限公司	202302 170002 0406	华宝股份	2023-0 2-17	49,70 0.00	2,000	14	3.40%	63.80	-	-
中信证券股份有限公司	202302 200000 8564	金龙鱼	2023-0 2-20	46,05 0.00	1,000	14	3.40%	59.12	-	-
中信证券股份有限公司	202302 240000 1046	华宝股份	2023-0 2-24	53,86 5.00	2,100	14	3.40%	69.15	-	-
中信证券股份有限公司	202302 240000 3902	金龙鱼	2023-0 2-24	133,51 6.00	2,900	14	3.40%	171.40	-	-
中信证券股份有限公司	202302 280002 2792	立高食品	2023-0 2-28	548,90 0.00	5,500	14	3.20%	663.18	-	-
中信证	202302	DR 嘉必	2023-0	249,85	4,900	14	3.20%	301.87	-	-

券股份有限公司	280002 2798	优	2-28	1.00							
中信证券股份有限公司	202302 280002 7676	三元生物	2023-0 2-28	179,35 0.00	5,000	14	3.20%	216.69	-	-	
中信证券股份有限公司	202302 280002 7678	华宝股份	2023-0 2-28	252,25 2.00	9,800	14	3.20%	304.77	-	-	
中信证券股份有限公司	202302 280002 7714	金龙鱼	2023-0 2-28	2,203, 879.00	47,900	14	3.20%	2,662. 72	-	-	
中信证券股份有限公司	202302 280002 7778	新诺威	2023-0 2-28	273,71 3.00	14,900	14	3.20%	330.70	-	-	
中信证券股份有限公司	202303 010001 4893	DR 嘉必优	2023-0 3-01	2,089, 458.00	41,400	14	3.40%	2,682. 26	-	-	
中信证券股份有限公司	202303 020001 5037	三元生物	2023-0 3-02	723,89 8.00	20,300	14	3.40%	929.27	-	-	
中信证券股份有限公司	202303 030000 1371	欢乐家	2023-0 3-03	48,29 8.00	3,800	14	3.40%	62.00	-	-	
中信证券股份有限公司	202303 030001 1079	华宝股份	2023-0 3-03	51,62 0.00	2,000	14	3.40%	66.26	-	-	
中信证券股份有限公司	202303 060001 6419	金龙鱼	2023-0 3-06	46,60 0.00	1,000	14	3.40%	59.83	-	-	
中信证券股份有限公司	202303 100000 1262	欢乐家	2023-0 3-10	22,26 6.00	1,800	14	3.40%	28.58	-	-	
中信证券股份有限公司	202303 100000 5927	华宝股份	2023-0 3-10	52,45 8.00	2,100	14	3.40%	67.34	-	-	
中信证券股份有限公司	202303 100000 5947	金龙鱼	2023-0 3-10	128,15 1.00	2,900	14	3.40%	164.50	-	-	
中信证券股份有限公司	202303 140002 5868	新诺威	2023-0 3-14	262,09 1.00	14,900	14	3.20%	316.66	-	-	

中信证券股份有限公司	202303 140002 5878	DR 嘉必优	2023-0 3-14	235,98 4.00	4,900	14	3.20%	285.12	-	-
中信证券股份有限公司	202303 140002 6472	立高食品	2023-0 3-14	585,36 5.00	5,500	14	3.20%	707.23	-	-
中信证券股份有限公司	202303 140002 7226	三元生物	2023-0 3-14	172,00 0.00	5,000	14	3.20%	207.81	-	-
中信证券股份有限公司	202303 140002 7228	华宝股份	2023-0 3-14	237,84 6.00	9,800	14	3.20%	287.37	-	-
中信证券股份有限公司	202303 150002 0607	DR 嘉必优	2023-0 3-15	1,945, 800.00	41,400	14	3.40%	2,497. 84	-	-
中信证券股份有限公司	202303 160001 2252	三元生物	2023-0 3-16	698,11 7.00	20,300	14	3.40%	896.18	-	-
中信证券股份有限公司	202303 170000 8857	华宝股份	2023-0 3-17	48,42 0.00	2,000	14	3.40%	62.16	-	-
中信证券股份有限公司	202303 170001 0597	欢乐家	2023-0 3-17	45,90 4.00	3,800	14	3.40%	58.93	-	-
中信证券股份有限公司	202303 240000 5163	金龙鱼	2023-0 3-24	126,64 3.00	2,900	14	3.40%	162.57	-	-
中信证券股份有限公司	202303 240000 5661	华宝股份	2023-0 3-24	53,38 2.00	2,100	14	3.40%	68.52	-	-
中信证券股份有限公司	202303 270000 1616	欢乐家	2023-0 3-27	16,58 8.00	1,300	14	3.40%	21.29	-	-
中信证券股份有限公司	202303 280002 0839	华宝股份	2023-0 3-28	248,43 0.00	9,800	14	3.20%	300.16	-	-
中信证券股份有限公司	202303 280002 2043	三元生物	2023-0 3-28	172,45 0.00	5,000	14	3.20%	208.35	-	-
中信证券股份有限公司	202303 280002 2119	新诺威	2023-0 3-28	302,47 0.00	14,900	14	3.20%	365.45	-	-

司										
中信证 券股份 有限公 司	202303 280002 4971	立高食 品	2023-0 3-28	566,06 0.00	5,500	14	3.20%	683.91	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202303 280002 6523	DR 嘉必 优	2023-0 3-28	200,11 6.00	4,900	14	3.20%	241.78	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202303 290001 7474	DR 嘉必 优	2023-0 3-29	1,639, 440.00	41,400	14	3.40%	2,104. 56	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202303 300001 5731	三元生 物	2023-0 3-30	698,92 9.00	20,300	14	3.40%	897.22	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202303 310000 8893	华宝股 份	2023-0 3-31	51,26 0.00	2,000	14	3.40%	65.81	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202303 310001 1661	欢乐家	2023-0 3-31	49,21 0.00	3,800	14	3.40%	63.17	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 070000 6837	金龙鱼	2023-0 4-07	124,84 5.00	2,900	14	3.40%	160.26	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 070000 6969	华宝股 份	2023-0 4-07	53,40 3.00	2,100	14	3.40%	68.55	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 100000 4408	金禾实 业	2023-0 4-10	1,494, 744.00	48,800	14	3.20%	1,805. 95	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 110001 7346	新诺威	2023-0 4-11	329,88 6.00	14,900	14	3.20%	398.56	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 110001 7356	立高食 品	2023-0 4-11	530,80 5.00	5,500	14	3.20%	641.32	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 110001 7378	DR 嘉必 优	2023-0 4-11	180,61 4.00	4,900	14	3.20%	218.21	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 110001 9648	华宝股 份	2023-0 4-11	247,45 0.00	9,800	14	3.20%	298.97	-	-
中信证 券股份	202304 110001	三元生 物	2023-0 4-11	166,15 0.00	5,000	14	3.20%	200.74	-	-

有限公司	9650									
中信证券股份有限公司	202304 120002 8602	DR 嘉必优	2023-0 4-12	1,521, 864.00	41,400	14	3.40%	1,953. 63	-	-
中信证券股份有限公司	202304 130001 4105	三元生物	2023-0 4-13	669,69 7.00	20,300	14	3.40%	859.70	-	-
中信证券股份有限公司	202304 170000 3554	星湖科技	2023-0 4-17	1,295, 805.00	210,70 0	14	3.20%	1,901. 08	-	-
中信证券股份有限公司	202304 170000 3646	贝因美	2023-0 4-17	62,72 0.00	14,000	14	3.20%	92.02	-	-
中信证券股份有限公司	202304 180000 4757	星湖科技	2023-0 4-18	61,61 0.00	10,100	14	3.20%	85.07	-	-
中信证券股份有限公司	202304 190000 3578	贝因美	2023-0 4-19	280,08 8.00	62,800	14	3.20%	362.57	-	-
中信证券股份有限公司	202304 190000 3585	华宝股份	2023-0 4-19	634,60 8.00	22,600	14	3.40%	872.84	-	-
中信证券股份有限公司	202304 200000 2462	金达威	2023-0 4-20	804,42 0.00	36,900	14	3.20%	971.90	-	-
中信证券股份有限公司	202304 210000 3082	金种子酒	2023-0 4-21	891,72 0.00	36,000	14	3.20%	1,077. 38	-	-
中信证券股份有限公司	202304 210000 3215	酒鬼酒	2023-0 4-21	1,977, 162.00	17,400	14	3.20%	2,388. 81	-	-
中信证券股份有限公司	202304 210000 3217	金禾实业	2023-0 4-21	1,944, 540.00	70,200	14	3.20%	2,349. 39	-	-
中信证券股份有限公司	202304 240000 3263	龙大美食	2023-0 4-24	2,009, 250.00	237,50 0	14	3.20%	2,427. 57	-	-
中信证券股份有限公司	202304 240000 3267	皇氏集团	2023-0 4-24	287,10 0.00	49,500	14	3.20%	346.87	-	-
中信证	202304	欢乐家	2023-0	25,23	1,900	14	3.40%	32.39	-	-

券股份有限公司	240000 3273		4-24	2.00						
中信证券股份有限公司	202304 250000 2893	安井食品	2023-0 4-25	2,198, 856.00	13,200	14	3.20%	2,656. 65	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250000 2995	皇氏集团	2023-0 4-25	547,94 7.00	96,300	14	3.20%	662.03	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 0429	双塔食品	2023-0 4-25	310,06 8.00	59,400	14	2.59%	303.21	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 0495	海天味业	2023-0 4-25	7,888, 625.00	111,50 0	14	2.59%	7,714. 17	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 0535	舍得酒业	2023-0 4-25	3,353, 208.00	18,600	14	2.59%	3,279. 06	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 1115	顺鑫农业	2023-0 4-25	1,362, 860.00	41,500	14	2.62%	1,348. 16	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 1957	三元生物	2023-0 4-25	154,50 0.00	5,000	14	2.59%	151.09	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 2017	千禾味业	2023-0 4-25	1,064, 449.00	46,100	14	2.59%	1,040. 91	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 2039	新诺威	2023-0 4-25	339,57 1.00	14,900	14	2.59%	332.06	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 2077	新乳业	2023-0 4-25	245,05 7.00	13,900	14	2.59%	239.64	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 3243	古越龙山	2023-0 4-25	488,51 6.00	51,100	14	2.59%	477.71	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 3869	迎驾贡酒	2023-0 4-25	1,168, 896.00	19,200	14	2.59%	1,143. 05	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 3961	张裕A	2023-0 4-25	320,78 7.00	10,900	14	2.59%	313.69	-	-

中信证券股份有限公司	202304 250005 4003	安井食品	2023-0 4-25	2,365, 436.00	14,200	14	2.59%	2,313. 13	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 4489	水井坊	2023-0 4-25	1,022, 576.00	15,800	14	2.59%	999.96	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 4519	洋河股份	2023-0 4-25	7,314, 692.00	48,400	14	2.59%	7,152. 93	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 4531	酒鬼酒	2023-0 4-25	2,021, 656.00	18,200	14	2.59%	1,976. 95	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 4633	煌上煌	2023-0 4-25	187,27 5.00	16,500	14	2.59%	183.14	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 4655	DR 嘉必优	2023-0 4-25	180,56 5.00	4,900	14	2.59%	176.57	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 4815	妙可蓝多	2023-0 4-25	753,71 2.00	28,900	14	2.62%	745.58	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 4825	金徽酒	2023-0 4-25	410,98 4.00	16,400	14	2.62%	406.55	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 4827	光明乳业	2023-0 4-25	559,17 6.00	55,200	14	2.62%	553.15	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 6101	山西汾酒	2023-0 4-25	9,390, 420.00	39,000	14	2.59%	9,182. 76	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 6369	燕京啤酒	2023-0 4-25	1,511, 016.00	113,10 0	14	2.59%	1,477. 60	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 7317	泸州老窖	2023-0 4-25	13,32 8,232. 00	59,100	14	2.59%	13,03 3.49	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 7651	立高食品	2023-0 4-25	515,90 0.00	5,500	14	2.59%	504.49	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250005 7655	星湖科技	2023-0 4-25	306,43 2.00	53,200	14	2.59%	299.66	-	-

司										
中信证 券股份 有限公 司	202304 250005 7777	重庆啤 酒	2023-0 4-25	2,044, 449.00	19,300	14	2.59%	1,999. 23	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250005 8257	天佑德 酒	2023-0 4-25	315,53 0.00	22,700	14	2.62%	312.13	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250005 8309	来伊份	2023-0 4-25	172,48 4.00	10,700	14	2.59%	168.67	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250005 8359	西王食 品	2023-0 4-25	196,56 0.00	43,200	14	2.59%	192.21	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250005 9899	贝因美	2023-0 4-25	295,91 1.00	69,300	14	2.59%	289.37	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250005 9979	安琪酵 母	2023-0 4-25	1,634, 223.00	41,700	14	2.59%	1,598. 09	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250006 0019	今世缘	2023-0 4-25	2,961, 298.00	50,200	14	2.59%	2,895. 82	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250006 0063	广州酒 家	2023-0 4-25	522,18 5.00	18,100	14	2.59%	510.64	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250006 0069	金达威	2023-0 4-25	500,53 5.00	24,500	14	2.59%	489.47	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250006 1335	桃李面 包	2023-0 4-25	602,92 4.00	42,700	14	2.59%	589.59	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250006 1349	三全食 品	2023-0 4-25	597,98 2.00	35,300	14	2.59%	584.76	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250006 1361	金禾实 业	2023-0 4-25	716,79 5.00	27,100	14	2.59%	700.94	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202304 250006 1389	华宝股 份	2023-0 4-25	269,40 2.00	9,800	14	2.59%	263.45	-	-
中信证 券股份	202304 250006	老白干 酒	2023-0 4-25	2,008, 714.00	58,700	14	2.59%	1,964. 29	-	-

有限公司	2393									
中信证券股份有限公司	202304 250006 2395	恒顺醋业	2023-0 4-25	536,61 3.00	48,300	14	2.59%	524.75	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250006 3907	珠江啤酒	2023-0 4-25	332,28 0.00	35,500	14	2.59%	324.93	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250006 4143	承德露露	2023-0 4-25	462,71 5.00	51,700	14	2.59%	452.49	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250006 4155	京粮控股	2023-0 4-25	198,43 6.00	26,600	14	2.59%	194.05	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250006 6309	涪陵榨菜	2023-0 4-25	1,186, 500.00	50,000	14	2.60%	1,164. 74	-	-
中信证券股份有限公司	202304 250006 6595	养元饮品	2023-0 4-25	1,053, 405.00	40,500	14	2.59%	1,030. 11	-	-
中信证券股份有限公司	202304 260000 3586	安琪酵母	2023-0 4-26	1,690, 432.00	43,300	14	3.20%	2,042. 38	-	-
中信证券股份有限公司	202304 260000 3596	安井食品	2023-0 4-26	14,44 8,720. 00	84,200	7	3.40%	10,59 8.84	-	-
中信证券股份有限公司	202304 270000 4188	DR 嘉必优	2023-0 4-27	381,48 0.00	10,200	14	3.40%	489.71	-	-
中信证券股份有限公司	202304 270000 4231	重庆啤酒	2023-0 4-27	1,079, 874.00	10,200	14	3.20%	1,304. 70	-	-
中信证券股份有限公司	202304 270001 3170	三元生物	2023-0 4-27	614,88 7.00	20,300	14	3.40%	789.34	-	-
中信证券股份有限公司	202304 280000 3557	三全食品	2023-0 4-28	1,984, 080.00	118,10 0	14	3.20%	2,397. 16	-	-
中信证券股份有限公司	202305 040000 4557	伊力特	2023-0 5-04	2,071, 036.00	77,800	14	3.20%	2,502. 22	-	-
中信证	202305	华宝股	2023-0	923,51	39,500	14	3.40%	1,185.	-	-

券股份有限公司	040000 4575	份	5-04	0.00				52		
中信证券股份有限公司	202305 040001 3853	金达威	2023-0 5-04	775,63 8.00	36,900	14	3.20%	937.13	-	-
中信证券股份有限公司	202305 040001 3901	星湖科技	2023-0 5-04	55,75 2.00	10,100	14	3.20%	67.36	-	-
中信证券股份有限公司	202305 040001 3935	星湖科技	2023-0 5-04	1,163, 064.00	210,70 0	14	3.20%	1,405. 21	-	-
中信证券股份有限公司	202305 040001 8273	贝因美	2023-0 5-04	62,16 0.00	14,000	14	3.20%	75.10	-	-
中信证券股份有限公司	202305 040003 0567	华宝股份	2023-0 5-04	528,38 8.00	22,600	14	3.40%	678.30	-	-
中信证券股份有限公司	202305 040003 6445	贝因美	2023-0 5-04	278,83 2.00	62,800	14	3.20%	336.88	-	-
中信证券股份有限公司	202305 050000 4074	安井食品	2023-0 5-05	2,001, 360.00	12,000	14	3.20%	2,418. 04	-	-
中信证券股份有限公司	202305 050000 4121	金种子酒	2023-0 5-05	1,381, 958.00	56,200	14	3.20%	1,669. 68	-	-
中信证券股份有限公司	202305 050000 4243	顺鑫农业	2023-0 5-05	1,969, 435.00	53,300	14	3.20%	2,379. 47	-	-
中信证券股份有限公司	202305 050000 5867	酒鬼酒	2023-0 5-05	1,891, 380.00	17,400	14	3.20%	2,285. 16	-	-
中信证券股份有限公司	202305 050000 7345	金种子酒	2023-0 5-05	885,24 0.00	36,000	14	3.20%	1,069. 54	-	-
中信证券股份有限公司	202305 080001 4275	龙大美食	2023-0 5-08	2,002, 125.00	237,50 0	14	3.20%	2,418. 96	-	-
中信证券股份有限公司	202305 080002 2501	欢乐家	2023-0 5-08	28,50 0.00	1,900	14	3.40%	36.58	-	-

中信证券股份有限公司	2023050900009117	酒鬼酒	2023-05-09	1,965,600.00	18,200	14	2.87%	2,129.93	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900009409	三全食品	2023-05-09	569,389.00	35,300	14	2.87%	616.99	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900009551	老白干酒	2023-05-09	1,823,809.00	58,700	14	2.87%	1,976.28	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900009565	新乳业	2023-05-09	230,045.00	13,900	14	2.87%	249.28	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900009867	金达威	2023-05-09	488,285.00	24,500	14	2.89%	532.80	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900009873	舍得酒业	2023-05-09	3,098,202.00	18,600	14	2.89%	3,380.61	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900009881	重庆啤酒	2023-05-09	1,932,509.00	19,300	14	2.89%	2,108.67	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900010903	广州酒家	2023-05-09	525,805.00	18,100	14	2.87%	569.77	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900010987	燕京啤酒	2023-05-09	1,391,130.00	113,100	14	2.87%	1,507.44	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900011889	金禾实业	2023-05-09	700,264.00	27,100	14	2.87%	758.81	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900011917	安井食品	2023-05-09	2,140,776.00	13,200	14	3.20%	2,586.49	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900011927	妙可蓝多	2023-05-09	736,083.00	28,900	14	2.87%	797.62	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900012181	煌上煌	2023-05-09	195,195.00	16,500	14	2.87%	211.51	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900012357	西王食品	2023-05-09	209,520.00	43,200	14	2.87%	227.04	-	-

司										
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 2427	恒顺醋 业	2023-0 5-09	544,34 1.00	48,300	14	2.87%	589.85	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 2443	珠江啤 酒	2023-0 5-09	325,18 0.00	35,500	14	2.87%	352.37	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 2463	张裕A	2023-0 5-09	354,57 7.00	10,900	14	2.87%	384.22	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 2531	千禾味 业	2023-0 5-09	1,132, 677.00	46,100	14	2.87%	1,227. 37	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 2633	安琪酵 母	2023-0 5-09	1,622, 964.00	41,700	14	2.87%	1,758. 65	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 3655	迎驾贡 酒	2023-0 5-09	1,212, 672.00	19,200	14	2.87%	1,314. 06	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 4339	双塔食 品	2023-0 5-09	302,94 0.00	59,400	14	2.87%	328.26	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 4739	桃李面 包	2023-0 5-09	473,54 3.00	42,700	14	2.87%	513.14	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 4829	涪陵榨 菜	2023-0 5-09	1,248, 000.00	50,000	14	2.87%	1,352. 34	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 5275	海天味 业	2023-0 5-09	7,622, 140.00	111,50 0	14	2.87%	8,259. 38	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 5279	星湖科 技	2023-0 5-09	289,94 0.00	53,200	14	2.87%	314.18	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 5281	今世缘	2023-0 5-09	3,041, 618.00	50,200	14	2.87%	3,295. 90	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 090001 5305	山西汾 酒	2023-0 5-09	9,411, 480.00	39,000	14	2.87%	10,19 8.31	-	-
中信证 券股份	202305 090001	泸州老 窖	2023-0 5-09	13,07 5,875.	59,100	14	2.87%	14,16 9.06	-	-

有限公司	5309			00						
中信证券股份有限公司	2023050900016013	承德露露	2023-05-09	462,715.00	51,700	14	2.87%	501.40	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900018551	三元生物	2023-05-09	149,250.00	5,000	14	2.87%	161.73	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900018627	DR 嘉必优	2023-05-09	148,470.00	4,900	14	2.87%	160.88	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900019341	金徽酒	2023-05-09	414,428.00	16,400	14	2.87%	449.08	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900019343	华宝股份	2023-05-09	227,360.00	9,800	14	2.87%	246.37	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900021069	来伊份	2023-05-09	173,340.00	10,700	14	2.87%	187.84	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900021149	京粮控股	2023-05-09	205,086.00	26,600	14	2.87%	222.23	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900021209	水井坊	2023-05-09	993,030.00	15,800	14	2.87%	1,076.05	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900021221	洋河股份	2023-05-09	7,128,836.00	48,400	14	2.87%	7,724.83	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900021653	古越龙山	2023-05-09	510,489.00	51,100	14	2.87%	553.16	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900021693	顺鑫农业	2023-05-09	1,477,400.00	41,500	14	2.89%	1,612.07	-	-
中信证券股份有限公司	2023050900021711	立高食品	2023-05-09	479,655.00	5,500	14	2.89%	523.38	-	-
中信证券股份有限公司	2023051000004239	皇氏集团	2023-05-10	784,720.00	136,000	14	3.20%	948.10	-	-
中信证	202305	金禾实	2023-0	2,048,	77,400	14	3.20%	2,475.	-	-

券股份有限公司	100000 4256	业	5-10	778.00				33		
中信证券股份有限公司	202305 100000 7848	安琪酵母	2023-0 5-10	1,688, 700.00	43,300	14	3.20%	2,040. 28	-	-
中信证券股份有限公司	202305 110000 4419	妙可蓝多	2023-0 5-11	1,993, 960.00	79,000	14	3.20%	2,409. 10	-	-
中信证券股份有限公司	202305 110000 4452	良品铺子	2023-0 5-11	1,367, 829.00	42,100	14	3.20%	1,652. 61	-	-
中信证券股份有限公司	202305 110001 2327	DR 嘉必优	2023-0 5-11	307,42 8.00	10,200	14	3.40%	394.65	-	-
中信证券股份有限公司	202305 110001 6013	三元生物	2023-0 5-11	618,33 8.00	20,300	14	3.40%	793.77	-	-
中信证券股份有限公司	202305 120000 6024	三全食品	2023-0 5-12	1,903, 772.00	118,10 0	14	3.20%	2,300. 14	-	-
中信证券股份有限公司	202305 180000 4638	华宝股份	2023-0 5-18	863,47 0.00	39,500	14	3.40%	1,108. 45	-	-
中信证券股份有限公司	202305 180000 4724	华宝股份	2023-0 5-18	494,03 6.00	22,600	14	3.40%	634.20	-	-
中信证券股份有限公司	202305 180001 3288	伊力特	2023-0 5-18	2,129, 386.00	77,800	14	3.20%	2,572. 72	-	-
中信证券股份有限公司	202305 180001 9858	星湖科技	2023-0 5-18	55,14 6.00	10,100	14	3.20%	66.63	-	-
中信证券股份有限公司	202305 180002 1504	星湖科技	2023-0 5-18	1,150, 422.00	210,70 0	14	3.20%	1,389. 94	-	-
中信证券股份有限公司	202305 180002 4858	金达威	2023-0 5-18	719,91 9.00	36,900	14	3.20%	869.81	-	-
中信证券股份有限公司	202305 190000 7927	安井食品	2023-0 5-19	1,962, 000.00	12,000	14	3.20%	2,370. 49	-	-

中信证券股份有限公司	2023051900008443	顺鑫农业	2023-05-19	1,818,596.00	53,300	14	3.20%	2,197.22	-	-
中信证券股份有限公司	2023051900010527	金种子酒	2023-05-19	814,680.00	36,000	14	3.20%	984.29	-	-
中信证券股份有限公司	2023051900011489	金种子酒	2023-05-19	1,271,806.00	56,200	14	3.20%	1,536.59	-	-
中信证券股份有限公司	2023051900012837	酒鬼酒	2023-05-19	1,828,218.00	17,400	14	3.20%	2,208.85	-	-
中信证券股份有限公司	2023052200031764	龙大美食	2023-05-22	2,073,375.00	237,500	14	3.20%	2,505.05	-	-
中信证券股份有限公司	2023052300009960	三全食品	2023-05-23	575,743.00	35,300	14	3.12%	678.22	-	-
中信证券股份有限公司	2023052300013298	涪陵榨菜	2023-05-23	1,220,500.00	50,000	14	3.12%	1,437.74	-	-
中信证券股份有限公司	2023052300013342	顺鑫农业	2023-05-23	1,460,800.00	41,500	14	3.12%	1,720.82	-	-
中信证券股份有限公司	2023052300013378	立高食品	2023-05-23	437,470.00	5,500	14	3.12%	515.34	-	-
中信证券股份有限公司	2023052300016184	重庆啤酒	2023-05-23	1,845,659.00	19,300	14	3.12%	2,174.17	-	-
中信证券股份有限公司	2023052300016270	承德露露	2023-05-23	478,225.00	51,700	14	3.12%	563.35	-	-
中信证券股份有限公司	2023052300017372	安琪酵母	2023-05-23	1,626,717.00	41,700	14	3.12%	1,916.26	-	-
中信证券股份有限公司	2023052300017374	恒顺醋业	2023-05-23	548,688.00	48,300	14	3.12%	646.35	-	-
中信证券股份有限公司	2023052300017412	金徽酒	2023-05-23	417,708.00	16,400	14	3.12%	492.06	-	-

司										
中信证 券股份 有限公 司	202305 230001 7494	金禾实 业	2023-0 5-23	699,45 1.00	27,100	14	3.12%	823.95	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230001 7506	今世缘	2023-0 5-23	2,947, 242.00	50,200	14	3.12%	3,471. 84	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230001 9300	妙可蓝 多	2023-0 5-23	699,38 0.00	28,900	14	3.12%	823.86	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230001 9320	燕京啤 酒	2023-0 5-23	1,389, 999.00	113,10 0	14	3.12%	1,637. 41	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230001 9902	桃李面 包	2023-0 5-23	470,12 7.00	42,700	14	3.12%	553.81	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230001 9932	新乳业	2023-0 5-23	231,15 7.00	13,900	14	3.12%	272.30	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230002 0058	珠江啤 酒	2023-0 5-23	323,40 5.00	35,500	14	3.12%	380.97	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230002 0066	双塔食 品	2023-0 5-23	292,84 2.00	59,400	14	3.12%	344.96	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230002 1166	煌上煌	2023-0 5-23	189,75 0.00	16,500	14	3.12%	223.52	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230002 1184	泸州老 窖	2023-0 5-23	13,04 3,370. 00	59,100	14	3.12%	15,36 5.01	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230002 1278	舍得酒 业	2023-0 5-23	3,090, 948.00	18,600	14	3.12%	3,641. 12	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230002 1832	DR 嘉必 优	2023-0 5-23	152,48 8.00	4,900	14	3.12%	179.63	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202305 230002 1928	广州酒 家	2023-0 5-23	524,90 0.00	18,100	14	3.12%	618.33	-	-
中信证 券股份	202305 230002	海天味 业	2023-0 5-23	7,282, 065.00	111,50 0	14	3.12%	8,578. 22	-	-

有限公司	1930									
中信证券股份有限公司	202305 230002 1932	星湖科技	2023-0 5-23	292,06 8.00	53,200	14	3.12%	344.06	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 1934	金达威	2023-0 5-23	489,26 5.00	24,500	14	3.12%	576.35	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 1998	千禾味业	2023-0 5-23	1,042, 321.00	46,100	14	3.12%	1,227. 84	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 2006	京粮控股	2023-0 5-23	201,89 4.00	26,600	14	3.12%	237.83	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 2608	来伊份	2023-0 5-23	163,60 3.00	10,700	14	3.12%	192.72	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 2614	三元生物	2023-0 5-23	161,00 0.00	5,000	14	3.12%	189.66	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 2864	洋河股份	2023-0 5-23	6,935, 720.00	48,400	14	3.12%	8,170. 23	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 2868	老白干酒	2023-0 5-23	1,772, 153.00	58,700	14	3.12%	2,087. 58	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 5636	山西汾酒	2023-0 5-23	8,337, 420.00	39,000	14	3.12%	9,821. 43	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 5660	古越龙山	2023-0 5-23	517,13 2.00	51,100	14	3.12%	609.17	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 5664	迎驾贡酒	2023-0 5-23	1,164, 480.00	19,200	14	3.12%	1,371. 75	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 5684	张裕A	2023-0 5-23	335,28 4.00	10,900	14	3.12%	394.96	-	-
中信证券股份有限公司	202305 230002 5694	西王食品	2023-0 5-23	195,26 4.00	43,200	14	3.12%	230.02	-	-
中信证	202305	水井坊	2023-0	1,004,	15,800	14	3.12%	1,183.	-	-

券股份 有限公司	230002 6928		5-23	248.00				00		
中信证 券股份 有限公司	202305 230002 7056	华宝股 份	2023-0 5-23	214,42 4.00	9,800	14	3.12%	252.59	-	-
中信证 券股份 有限公司	202305 240000 6776	金禾实 业	2023-0 5-24	1,970, 604.00	77,400	14	3.20%	2,380. 88	-	-
中信证 券股份 有限公司	202305 240000 6848	安琪酵 母	2023-0 5-24	1,661, 854.00	43,300	14	3.20%	2,007. 84	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 4061	山西汾 酒	2023-0 6-06	8,217, 300.00	39,000	14	3.54%	10,98 2.99	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 4093	重庆啤 酒	2023-0 6-06	1,842, 764.00	19,300	14	3.54%	2,462. 98	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 4815	千禾味 业	2023-0 6-06	951,04 3.00	46,100	14	3.54%	1,271. 14	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 5090	广州酒 家	2023-0 6-06	506,80 0.00	18,100	14	3.54%	677.37	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 5227	涪陵榨 菜	2023-0 6-06	1,185, 000.00	50,000	14	3.54%	1,583. 84	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 5465	金达威	2023-0 6-06	455,45 5.00	24,500	14	3.54%	608.75	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 5914	金徽酒	2023-0 6-06	377,52 8.00	16,400	14	3.54%	504.59	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 6194	西王食 品	2023-0 6-06	180,14 4.00	43,200	14	3.54%	240.78	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 6243	京粮控 股	2023-0 6-06	196,57 4.00	26,600	14	3.54%	262.74	-	-
中信证 券股份 有限公司	202306 060001 6313	迎驾贡 酒	2023-0 6-06	1,082, 304.00	19,200	14	3.54%	1,446. 57	-	-

中信证券股份有限公司	2023060600016518	舍得酒业	2023-06-06	2,543,736.00	18,600	14	3.54%	3,399.88	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600016523	妙可蓝多	2023-06-06	647,649.00	28,900	14	3.54%	865.63	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600016673	来伊份	2023-06-06	170,665.00	10,700	14	3.54%	228.11	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600016773	新乳业	2023-06-06	231,296.00	13,900	14	3.54%	309.15	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600017048	煌上煌	2023-06-06	177,705.00	16,500	14	3.54%	237.51	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600017375	三元生物	2023-06-06	152,800.00	5,000	14	3.54%	204.22	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600018031	恒顺醋业	2023-06-06	526,470.00	48,300	14	3.54%	703.66	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600018038	华宝股份	2023-06-06	212,660.00	9,800	14	3.54%	284.23	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600018311	泸州老窖	2023-06-06	12,351,309.00	59,100	14	3.54%	16,508.39	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600018360	海天味业	2023-06-06	5,513,675.00	111,500	14	3.54%	7,369.41	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600018427	张裕A	2023-06-06	327,109.00	10,900	14	3.54%	437.20	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600018917	古越龙山	2023-06-06	481,362.00	51,100	14	3.54%	643.38	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600018967	DR 嘉必优	2023-06-06	135,093.00	4,900	14	3.54%	180.56	-	-
中信证券股份有限公司	2023060600019197	金禾实业	2023-06-06	639,289.00	27,100	14	3.54%	854.46	-	-

司										
中信证 券股份 有限公 司	202306 060001 9432	珠江啤 酒	2023-0 6-06	315,95 0.00	35,500	14	3.54%	422.29	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060001 9514	燕京啤 酒	2023-0 6-06	1,365, 117.00	113,10 0	14	3.54%	1,824. 57	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060001 9761	水井坊	2023-0 6-06	928,25 0.00	15,800	14	3.54%	1,240. 67	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060002 0308	洋河股 份	2023-0 6-06	6,531, 580.00	48,400	14	3.54%	8,729. 91	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060002 0458	桃李面 包	2023-0 6-06	450,05 8.00	42,700	14	3.54%	601.53	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060002 0582	今世缘	2023-0 6-06	2,823, 248.00	50,200	14	3.54%	3,773. 47	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060002 0725	三全食 品	2023-0 6-06	554,21 0.00	35,300	14	3.54%	740.74	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060002 0944	承德露 露	2023-0 6-06	456,51 1.00	51,700	14	3.54%	610.16	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060002 1035	立高食 品	2023-0 6-06	405,13 0.00	5,500	14	3.54%	541.49	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060002 1460	双塔食 品	2023-0 6-06	270,27 0.00	59,400	14	3.54%	361.23	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 060002 1656	老白干 酒	2023-0 6-06	1,502, 720.00	58,700	14	3.54%	2,008. 49	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 150000 5969	上海梅 林	2023-0 6-15	2,013, 048.00	262,80 0	14	3.20%	2,432. 16	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202306 150000 6011	DR 嘉必 优	2023-0 6-15	368,67 6.00	12,600	14	3.40%	473.27	-	-
中信证 券股份	202306 150000	恒顺醋 业	2023-0 6-15	3,476, 733.00	310,70 0	14	3.20%	4,200. 58	-	-

有限公司	6015										
中信证券股份有限公司	202306 150000 6154	三元生物	2023-0 6-15	401,83 5.00	12,900	14	3.40%	515.84	-	-	
中信证券股份有限公司	202306 150000 6164	煌上煌	2023-0 6-15	384,16 0.00	34,300	14	3.20%	464.15	-	-	
中信证券股份有限公司	202306 150000 6180	龙大美食	2023-0 6-15	2,000, 115.00	236,70 0	14	3.20%	2,416. 53	-	-	
中信证券股份有限公司	202306 160000 8857	会稽山	2023-0 6-16	610,80 4.00	49,100	14	3.20%	737.97	-	-	
中信证券股份有限公司	202306 160000 8942	华宝股份	2023-0 6-16	466,33 5.00	21,500	14	3.40%	598.64	-	-	
中信证券股份有限公司	202306 160000 8947	皇氏集团	2023-0 6-16	8,414. 00	1,400	14	3.20%	10.16	-	-	
中信证券股份有限公司	202306 210000 5465	立高食品	2023-0 6-21	1,951, 560.00	27,800	14	3.40%	1,610. 48	1,902, 076.00	1,658.7 9	
中信证券股份有限公司	202306 270000 6783	古越龙山	2023-0 6-27	826,40 0.00	80,000	14	3.20%	213.96	830,40 0.00	220.38	
中信证券股份有限公司	202306 280000 7074	煌上煌	2023-0 6-28	16,08 0.00	1,500	14	3.20%	2.78	16,03 5.00	2.86	
中信证券股份有限公司	202306 280000 7086	顺鑫农业	2023-0 6-28	1,978, 008.00	58,400	14	3.20%	341.40	1,967, 496.00	351.64	
中信证券股份有限公司	202306 290000 8417	欢乐家	2023-0 6-29	43,98 0.00	3,000	14	3.40%	4.03	43,71 0.00	4.15	
中信证券股份有限公司	202306 290000 8423	皇氏集团	2023-0 6-29	953,50 4.00	143,60 0	14	3.20%	82.29	933,40 0.00	84.76	
中信证券股份有限公司	202306 290000 8429	新乳业	2023-0 6-29	1,501, 632.00	105,60 0	14	3.20%	129.59	1,515, 360.00	133.48	
中信证	202306	煌上煌	2023-0	381,98	35,800	14	3.20%	32.96	382,70	33.95	

券股份 有限公司	290000 8431		6-29	6.00					2.00	
中信证 券股份 有限公司	202306 290003 8457	DR 嘉必 优	2023-0 6-29	365,77 8.00	12,600	14	3.40%	33.54	375,48 0.00	34.55
中信证 券股份 有限公司	202306 290003 8459	上海梅 林	2023-0 6-29	1,915, 812.00	262,80 0	14	3.20%	165.33	1,918, 440.00	170.29
中信证 券股份 有限公司	202306 290004 0647	恒顺醋 业	2023-0 6-29	3,361, 774.00	310,70 0	14	3.20%	290.12	3,374, 202.00	298.82
中信证 券股份 有限公司	202306 290004 1396	煌上煌	2023-0 6-29	365,98 1.00	34,300	14	3.20%	31.58	366,66 7.00	32.53
中信证 券股份 有限公司	202306 290004 4202	龙大美 食	2023-0 6-29	1,957, 509.00	236,70 0	14	3.20%	168.93	1,962, 243.00	174.00
中信证 券股份 有限公司	202306 290004 5440	三元生 物	2023-0 6-29	410,86 5.00	12,900	14	3.40%	37.67	451,37 1.00	38.80
中信证 券股份 有限公司	202306 300000 2168	来伊份	2023-0 6-30	17,71 2.00	1,200	14	3.20%	-	17,71 2.00	-
中信证 券股份 有限公司	202306 300000 2271	酒鬼酒	2023-0 6-30	1,974, 285.00	21,900	14	3.20%	-	1,974, 285.00	-
中信证 券股份 有限公司	202306 300001 9246	华宝股 份	2023-0 6-30	460,53 0.00	21,500	14	3.40%	-	460,53 0.00	-
中信证 券股份 有限公司	202306 300001 9628	皇氏集 团	2023-0 6-30	9,100. 00	1,400	14	3.20%	-	9,100. 00	-
中信证 券股份 有限公司	202306 300002 1397	会稽山	2023-0 6-30	578,88 9.00	49,100	14	3.20%	-	578,88 9.00	-
上年度可比期间										
2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日										
关联方 名称	合约编 号	证券名 称	成交时 间	交易金 额	交易数 量(股)	出借期 限(天)	费率	利息收 入	期末证 券出借 业务余 额	期末应 收利息 余额

中信证券股份有限公司	2022041400000846	嘉必优	2022-04-14	1,584,000.00	49,500	14	3.40%	2,033.40	-	-
中信证券股份有限公司	2022041400000890	品渥食品	2022-04-14	778,720.00	24,800	14	3.40%	999.65	-	-
中信证券股份有限公司	2022041400000892	熊猫乳品	2022-04-14	698,118.00	30,700	14	3.40%	896.18	-	-
中信证券股份有限公司	2022041400000894	欢乐家	2022-04-14	638,880.00	48,400	14	3.40%	820.14	-	-
中信证券股份有限公司	2022041400000896	仲景食品	2022-04-14	1,004,400.00	24,800	14	3.40%	1,289.36	-	-
中信证券股份有限公司	2022041400000898	海融科技	2022-04-14	952,210.00	22,300	14	3.40%	1,222.36	-	-
中信证券股份有限公司	2022041500000916	立高食品	2022-04-15	481,250.00	5,500	14	3.40%	617.79	-	-
中信证券股份有限公司	2022041800000927	立高食品	2022-04-18	722,400.00	8,400	14	3.40%	1,126.07	-	-
中信证券股份有限公司	2022042000001160	立高食品	2022-04-20	2,543,612.00	28,100	14	3.40%	3,498.49	-	-
中信证券股份有限公司	2022042000001162	欢乐家	2022-04-20	40,600.00	2,900	14	3.40%	55.84	-	-
中信证券股份有限公司	2022042500000765	欢乐家	2022-04-25	44,548.00	3,700	14	3.40%	57.18	-	-
中信证券股份有限公司	2022042800007452	嘉必优	2022-04-28	1,311,255.00	49,500	14	3.40%	1,683.27	-	-
中信证券股份有限公司	2022042800007656	仲景食品	2022-04-28	753,176.00	24,800	14	3.40%	966.86	-	-
中信证券股份有限公司	2022042800007658	欢乐家	2022-04-28	521,268.00	48,400	14	3.40%	669.16	-	-

司										
中信证 券股份 有限公 司	202204 280000 8244	品渥食 品	2022-0 4-28	590,73 6.00	24,800	14	3.40%	758.33	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202204 280000 8246	海融科 技	2022-0 4-28	782,50 7.00	22,300	14	3.40%	1,004. 51	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202204 280000 8248	熊猫乳 品	2022-0 4-28	541,54 8.00	30,700	14	3.40%	695.19	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202204 290000 0978	欢乐家	2022-0 4-29	46,86 3.00	4,100	14	3.40%	60.16	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202204 290000 5426	立高食 品	2022-0 4-29	390,50 0.00	5,500	14	3.40%	501.29	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202205 050006 8527	欢乐家	2022-0 5-05	34,42 3.00	2,900	14	3.40%	44.18	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202205 050006 8529	立高食 品	2022-0 5-05	598,50 0.00	8,400	14	3.40%	768.30	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202205 060000 1104	海融科 技	2022-0 5-06	54,06 8.00	1,400	14	3.40%	69.41	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202205 090000 1507	嘉必优	2022-0 5-09	88,35 2.00	3,200	14	3.40%	113.42	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202205 090001 0027	欢乐家	2022-0 5-09	43,69 7.00	3,700	14	3.40%	56.10	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202205 120000 7202	海融科 技	2022-0 5-12	890,88 5.00	22,300	14	3.40%	1,143. 64	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202205 120000 7204	品渥食 品	2022-0 5-12	665,13 6.00	24,800	14	3.40%	853.84	-	-
中信证 券股份 有限公 司	202205 120000 7206	仲景食 品	2022-0 5-12	841,46 4.00	24,800	14	3.40%	1,080. 19	-	-
中信证 券股份	202205 120000	熊猫乳 品	2022-0 5-12	603,25 5.00	30,700	14	3.40%	774.41	-	-

有限公司	7208										
中信证券股份有限公司	202205 120000 8038	嘉必优	2022-0 5-12	1,640, 430.00	49,500	14	3.40%	2,105. 84	-	-	
中信证券股份有限公司	202205 130000 5104	立高食品	2022-0 5-13	399,68 5.00	5,500	14	3.40%	513.08	-	-	
中信证券股份有限公司	202205 160000 0746	欢乐家	2022-0 5-16	49,20 0.00	4,100	14	3.40%	63.16	-	-	
中信证券股份有限公司	202205 190004 2801	立高食品	2022-0 5-19	606,48 0.00	8,400	14	3.40%	778.54	-	-	
中信证券股份有限公司	202205 190004 4589	欢乐家	2022-0 5-19	34,19 1.00	2,900	14	3.40%	43.89	-	-	
中信证券股份有限公司	202206 230000 1023	嘉必优	2022-0 6-23	69,03 6.00	2,200	14	3.20%	41.73	72,05 0.00	42.98	
中信证券股份有限公司	202206 230000 1167	仲景食品	2022-0 6-23	63,39 6.00	1,800	14	3.20%	38.33	67,73 4.00	39.48	
中信证券股份有限公司	202206 230000 1168	汤臣倍健	2022-0 6-23	769,60 0.00	37,000	14	3.20%	464.92	801,05 0.00	478.87	
中信证券股份有限公司	202206 230000 1170	海融科技	2022-0 6-23	40,68 0.00	1,000	14	3.20%	24.60	47,42 0.00	25.34	
中信证券股份有限公司	202206 230000 1173	立高食品	2022-0 6-23	152,10 0.00	1,800	14	3.20%	91.88	187,11 0.00	94.64	
中信证券股份有限公司	202206 230000 1176	品渥食品	2022-0 6-23	29,31 5.00	1,100	14	3.20%	17.74	32,94 5.00	18.27	
中信证券股份有限公司	202206 230000 1179	金龙鱼	2022-0 6-23	1,017, 576.00	21,600	14	3.20%	614.71	1,166, 832.00	633.15	
中信证券股份有限公司	202206 230000 1180	欢乐家	2022-0 6-23	39,80 8.00	3,200	14	3.20%	24.06	42,75 2.00	24.78	
中信证	202206	海融科	2022-0	1,005,	21,200	14	3.40%	-	1,005,	-	

券股份 有限公司	300000 1984	技	6-30	304.00					304.00	
中信证 券股份 有限公司	202206 300000 1986	欢乐家	2022-0 6-30	359,38 4.00	26,900	14	3.40%	-	359,38 4.00	-
中信证 券股份 有限公司	202206 300000 1988	品渥食 品	2022-0 6-30	706,82 0.00	23,600	14	3.40%	-	706,82 0.00	-
中信证 券股份 有限公司	202206 300000 1990	仲景食 品	2022-0 6-30	1,482, 622.00	39,400	14	3.40%	-	1,482, 622.00	-
中信证 券股份 有限公司	202206 300000 2164	嘉必优	2022-0 6-30	1,549, 075.00	47,300	14	3.40%	-	1,549, 075.00	-

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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

关联方名 称	本期末 2023年06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
天弘中证 食品饮料 交易型开 放式指数 证券投资 基金联接 基金	6,186,106,300.00	97.08%	7,168,504,700.00	97.63%
中信证券 股份有限 公司	2,108,048.00	0.03%	7,203,101.00	0.10%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司	17,565,830.80	62,296.25	18,689,110.21	87,902.37

注：本基金由基金托管人中信证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信证券股份有限公司	603281	江瀚新材	网下申购	863	30,714.17
中信证券股份有限公司	301373	凌玮科技	网下申购	2,764	93,229.72
中信证券股份有限公司	688522	纳睿雷达	网下申购	4,299	200,677.32
中信证券股份有限公司	301157	华塑科技	网下申购	1,498	84,637.00

中信证券股份有限公司	301439	泓淋电力	网下申购	9,486	189,625.14
中信证券股份有限公司	603162	海通发展	网下申购	523	19,481.75
中信证券股份有限公司	001367	海森药业	网下申购	549	24,419.52
中信证券股份有限公司	601061	中信金属	网下申购	40,154	264,213.32
中信证券股份有限公司	001286	陕西能源	网下申购	37,667	361,603.20
中信证券股份有限公司	601133	柏诚股份	网下申购	6,632	77,329.12
中信证券股份有限公司	688539	高华科技	网下申购	5,334	203,865.48
中信证券股份有限公司	688146	中船特气	网下申购	10,101	365,151.15
中信证券股份有限公司	301293	三博脑科	网下申购	3,324	98,390.40
中信证券股份有限公司	001324	长青科技	网下申购	1,131	21,353.28
中信证券股份有限公司	688581	安杰思	网下申购	1,629	204,928.20

中信证券 股份有限 公司	688523	航天环宇	网下申购	4,717	103,113.62
中信证券 股份有限 公司	301323	新莱福	网下申购	2,277	88,939.62
中信证券 股份有限 公司	301170	锡南科技	网下申购	2,496	84,864.00
中信证券 股份有限 公司	688631	莱斯信息	网下申购	3,357	84,864.96
中信证券 股份有限 公司	301261	恒工精密	网下申购	1,973	72,803.70
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日					
关联方名 称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张 /股）	总金额
中信证券 股份有限 公司	301117	佳缘科技	网下申购	2,616	122,428.80
中信证券 股份有限 公司	301116	益客食品	网下申购	5,764	65,709.60
中信证券 股份有限 公司	688223	晶科能源	网下申购	213,000	1,065,000.00
中信证券 股份有限 公司	688171	纬德信息	网下申购	2,821	80,906.28
中信证券	603215	比依股份	网下申购	575	7,187.50

股份有限 公司					
中信证券 股份有限 公司	603132	金徽股份	网下申购	1,342	14,493.60
中信证券 股份有限 公司	301200	大族数控	网下申购	8,566	655,812.96
中信证券 股份有限 公司	001266	宏英智能	网下申购	247	9,536.67
中信证券 股份有限 公司	688150	莱特光电	网下申购	5,626	124,053.30
中信证券 股份有限 公司	603209	兴通股份	网下申购	595	12,804.40
中信证券 股份有限 公司	603051	鹿山新材	网下申购	272	7,014.88
中信证券 股份有限 公司	301109	军信股份	网下申购	12,250	426,422.50
中信证券 股份有限 公司	600938	中国海油	网上申购	3,000	32,400.00
中信证券 股份有限 公司	603191	望变电气	网下申购	1,149	13,627.14
中信证券 股份有限 公司	688290	景业智能	网下申购	3,040	103,025.60
中信证券	301238	瑞泰新材	网下申购	34,966	670,647.88

股份有限公司					
中信证券股份有限公司	688349	三一重能	网下申购	32,650	972,970.00
中信证券股份有限公司	301302	华如科技	网下申购	4,651	241,991.53
中信证券股份有限公司	688047	龙芯中科	网下申购	8,345	501,200.70
中信证券股份有限公司	301112	信邦智能	网下申购	3,984	109,679.52
中信证券股份有限公司	301175	中科环保	网下申购	63,694	243,311.08

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2023年06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
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内（含）	新股未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-

688539	高华科技	2023-04-11	6个月	科创板打新限售	38.22	43.49	5,334	203,865.48	231,975.66	-
688522	纳睿雷达	2023-02-22	6个月	科创板打新限售	46.68	51.50	4,299	200,677.32	221,398.50	-
688435	英方软件	2023-01-12	6个月	科创板打新限售	38.66	73.03	2,728	105,464.48	199,225.84	-
688486	龙迅股份	2023-02-10	6个月	科创板打新限售	64.76	105.13	1,887	122,202.12	198,380.31	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内(含)	新股未上市	26.68	26.68	5,196	138,629.28	138,629.28	-
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板打新限售	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,618	104,144.04	104,144.04	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6个月	科创板打新限售	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-

301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	创业板打新限售	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板打新限售	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	创业板打新限售	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	科创板打新限售	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	创业板打新限售	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-

688146	中船特气	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6个月	创业板打新限售	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股锁定	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	科创板打新限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	科创板打新限售	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6个月	科创板打新限售	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688582	N芯动	2023-06-21	6个月	科创板打新限售	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博	2023-04-2	6个月	创业	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-

	脑科	5		板打 新限 售							
3013 03	真兰 仪表	2023 -02-1 3	6个月	创业 板打 新限 售	26.80	22.32	1,058	28,35 4.40	23,61 4.56	-	
6885 52	航天 南湖	2023 -05-0 8	6个月	科创 板打 新限 售	21.17	23.50	956	20,23 8.52	22,46 6.00	-	
6885 70	天玛 智控	2023 -05-2 9	6个月	科创 板打 新限 售	30.26	25.33	884	26,74 9.84	22,39 1.72	-	
3013 07	美利 信	2023 -04-1 4	6个月	创业 板打 新限 售	32.34	31.86	687	22,21 7.58	21,88 7.82	-	
6885 43	国科 军工	2023 -06-1 4	6个月	科创 板打 新限 售	43.67	53.05	410	17,90 4.70	21,75 0.50	-	
3013 22	绿通 科技	2023 -02-2 7	6个月	创业 板打 新限 售	131.1 1	53.24	391	34,21 9.71	20,81 6.84	-	
6884 58	美芯 晟	2023 -05-1 5	6个月	科创 板打 新限 售	75.00	90.76	221	16,57 5.00	20,05 7.96	-	
6885 81	安杰 思	2023 -05-1 2	6个月	科创 板打 新限	125.8 0	118.0 3	163	20,50 5.40	19,23 8.89	-	

				售						
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	创业板打新限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	科创板打新限售	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
3014	华人	2023	6个月	创业	16.24	16.95	879	14,27	14,89	-

08	健康	-02-22		板打新限售				4.96	9.05	
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	创业板打新限售	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	C溯联	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	创业板打新限售	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	科创板打新限售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	科创板打新限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
301210	N金杨	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-

				售							
3013 20	豪江 智能	2023 -06-0 1	6个月	创业 板打 新限 售	13.06	20.62	642	8,38 4.52	13,23 8.04	-	
6884 33	华曙 高科	2023 -04-0 7	6个月	科创 板打 新限 售	26.66	31.50	418	11,14 3.88	13,16 7.00	-	
6886 29	C华 丰	2023 -06-1 6	6个月	科创 板打 新限 售	9.26	18.59	708	6,55 6.08	13,16 1.72	-	
6886 20	C安 凯微	2023 -06-1 5	6个月	科创 板打 新限 售	10.68	12.34	1,016	10,85 0.88	12,53 7.44	-	
3013 60	荣旗 科技	2023 -04-1 7	6个月	创业 板打 新限 售	71.88	92.60	134	9,63 1.92	12,40 8.40	-	
3013 45	涛涛 车业	2023 -03-1 0	6个月	创业 板打 新限 售	73.45	46.64	266	19,53 7.70	12,40 6.24	-	
3013 15	威士 顿	2023 -06-1 3	6个月	创业 板打 新限 售	32.29	51.12	226	7,29 7.54	11,55 3.12	-	
6885 23	航天 环宇	2023 -05-2 6	6个月	科创 板打 新限 售	21.86	23.85	472	10,31 7.92	11,25 7.20	-	
6031	中重	2023	6个月	新股	17.80	17.89	628	11,17	11,23	-	

35	科技	-03-29		锁定				8.40	4.92	
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	创业板打新限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	C莱斯	2023-06-19	6个月	科创板打新限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	科创板打新限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	创业板打新限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	创业板打新限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
3013	北方	2023	6个月	创业	50.00	48.39	190	9,50	9,19	-

57	长龙	-04-11		板打新限售				0.00	4.10	
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	创业板打新限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	创业板打新限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	C时创	2023-06-20	6个月	科创板打新限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	创业板打新限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301170	C锡南	2023-06-16	6个月	创业板打新限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	创业板打新限售	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	科创板打新限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-

301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	创业板打新限售	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301295	C美硕	2023-06-19	6个月	创业板打新限售	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
300804	C广康	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	创业板打新限售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-

603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111014	李子转债	2023-06-20	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	7,420	742,000.00	742,053.67	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、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。

4、创业板新股致尚科技（证券代码：301486）于2023年07月07日起上市流通，本基金获配的股数中482股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月08日。

5、创业板新股仁信新材（证券代码：301395）于2023年07月03日起上市流通，本基金获配的股数中520股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月03日。

6、创业板新股海科新源（证券代码：301292）于2023年07月07日起上市流通，本基金获配的股数中583股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月08日。

7、创业板新股豪恩汽电（证券代码：301488）于2023年07月04日起上市流通，本基金获配的股数中262股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月04日。

8、创业板新股朗威股份（证券代码：301202）于2023年07月05日起上市流通，本基金获配的股数中306股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月05日。

9、科创板新股天承科技（证券代码：688603）于2023年07月10日起上市流通，本基金获配的股数中140股根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月10日。

10、创业板新股恒工精密（证券代码：301261）于2023年07月10日起上市流通，本基金获配的股数中198股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月10日。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

截至本报告期末2023年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值	数量（单	期末估值
---	------	------	-------	------	------	------

号				单价	位：股)	总额
1	000505	京粮控股	2023年07月12日- 2023年07月13日	7.44	199,500	1,484,280. 00
2	000639	西王食品	2023年07月06日- 2023年07月11日	4.59	329,600	1,512,864. 00
3	000729	燕京啤酒	2023年07月12日- 2023年07月12日	12.47	197,000	2,456,590. 00
4	000799	酒鬼酒	2023年07月04日- 2023年07月14日	90.15	85,400	7,698,810. 00
5	000860	顺鑫农业	2023年07月12日- 2023年07月12日	33.69	58,400	1,967,496. 00
6	002304	洋河股份	2023年07月13日- 2023年07月13日	131.35	1,600	210,160.00
7	002329	皇氏集团	2023年07月13日- 2023年07月14日	6.50	372,200	2,419,300. 00
8	002481	双塔食品	2023年07月12日- 2023年07月12日	4.46	51,600	230,136.00
9	002646	天佑德酒	2023年07月11日- 2023年07月11日	13.49	16,800	226,632.00
10	002695	煌上煌	2023年07月12日- 2023年07月13日	10.69	103,100	1,102,139. 00
11	002726	龙大美食	2023年07月12日- 2023年07月14日	8.29	444,000	3,680,760. 00
12	002840	华统股份	2023年07月12日- 2023年07月14日	15.64	187,400	2,930,936. 00
13	002946	新乳业	2023年07月13日- 2023年07月13日	14.35	105,600	1,515,360. 00
14	300741	华宝股份	2023年07月13日- 2023年07月14日	21.42	74,500	1,595,790. 00
15	300765	新诺威	2023年07月12日- 2023年07月13日	12.89	175,000	2,255,750. 00
16	300973	立高食品	2023年07月05日- 2023年07月05日	68.42	27,800	1,902,076. 00

17	300997	欢乐家	2023年07月03日- 2023年07月13日	14.57	54,400	792,608.00
18	300999	金龙鱼	2023年07月12日- 2023年07月12日	39.99	6,100	243,939.00
19	301206	三元生物	2023年07月12日- 2023年07月13日	34.99	49,000	1,714,510.00
20	600059	古越龙山	2023年07月11日- 2023年07月11日	10.38	80,000	830,400.00
21	600073	上海梅林	2023年07月13日- 2023年07月13日	7.30	262,800	1,918,440.00
22	600132	重庆啤酒	2023年07月12日- 2023年07月14日	92.16	25,600	2,359,296.00
23	600197	伊力特	2023年07月04日- 2023年07月12日	27.17	34,400	934,648.00
24	600199	金种子酒	2023年07月03日- 2023年07月14日	23.74	321,300	7,627,662.00
25	600238	海南椰岛	2023年07月03日- 2023年07月14日	11.14	273,400	3,045,676.00
26	600298	安琪酵母	2023年07月03日- 2023年07月03日	36.21	122,400	4,432,104.00
27	600305	恒顺醋业	2023年07月12日- 2023年07月14日	10.86	339,700	3,689,142.00
28	600559	老白干酒	2023年07月03日- 2023年07月14日	24.51	144,100	3,531,891.00
29	600702	舍得酒业	2023年07月05日- 2023年07月13日	123.95	135,700	16,820,015.00
30	600737	中粮糖业	2023年07月10日- 2023年07月10日	8.05	168,600	1,357,230.00
31	600779	水井坊	2023年07月04日- 2023年07月04日	58.99	21,600	1,274,184.00
32	600809	山西汾酒	2023年07月11日- 2023年07月11日	185.07	1,000	185,070.00
33	600882	妙可蓝多	2023年07月03日-	22.28	28,100	626,068.00

			2023年07月14日			
34	601579	会稽山	2023年07月14日- 2023年07月14日	11.79	49,100	578,889.00
35	603043	广州酒家	2023年07月12日- 2023年07月12日	28.26	10,000	282,600.00
36	603156	养元饮品	2023年07月14日- 2023年07月14日	24.70	2,500	61,750.00
37	603198	迎驾贡酒	2023年07月04日- 2023年07月14日	63.80	45,000	2,871,000. 00
38	603345	安井食品	2023年07月05日- 2023年07月13日	146.80	97,100	14,254,28 0.00
39	603517	绝味食品	2023年07月12日- 2023年07月13日	37.15	231,300	8,592,795. 00
40	603589	口子窖	2023年07月12日- 2023年07月12日	49.35	57,500	2,837,625. 00
41	603719	良品铺子	2023年07月12日- 2023年07月13日	25.01	72,600	1,815,726. 00
42	603777	来伊份	2023年07月12日- 2023年07月14日	14.76	82,300	1,214,748. 00
43	603919	金徽酒	2023年07月12日- 2023年07月12日	23.48	10,900	255,932.00
44	605499	东鹏饮料	2023年07月13日- 2023年07月13日	172.90	26,300	4,547,270. 00
45	688089	DR嘉必 优	2023年07月13日- 2023年07月13日	29.80	43,100	1,284,380. 00
合计					5,225,400	123,168,95 7.00

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

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要

投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中信证券股份有限公司开立于具有基

金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，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。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级AA级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

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06月30日	上年度末 2022年12月31日

AAA	-	-
AAA以下	742,053.67	-
未评级	-	-
合计	742,053.67	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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 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%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

人建立了交易对手管理制度：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。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 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	17,565,830.80	-	-	-	17,565,830.80
结算备付金	499,461.74	-	-	-	499,461.74
存出保证金	799,085.00	-	-	-	799,085.00
交易性金融资产	-	-	742,053.67	5,345,494,140.33	5,346,236,194.00
应收股利	-	-	-	4,986.90	4,986.90
其他资产	-	-	-	121,099.31	121,099.31
资产总计	18,864,377.54	-	742,053.67	5,345,620,226.54	5,365,226,657.75
负债					
应付清算款	-	-	-	12,500,564.38	12,500,564.38
应付管理人报酬	-	-	-	2,230,301.12	2,230,301.12
应付托管费	-	-	-	446,060.20	446,060.20
应交税费	-	-	-	27,082.55	27,082.55
其他负债	-	-	-	365,260.44	365,260.44
负债总计	-	-	-	15,569,268.69	15,569,268.69

利率敏感度缺口	18,864,377.54	-	742,053.67	5,330,050,957.85	5,349,657,389.06
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	5,881,410.96	-	-	-	5,881,410.96
结算备付金	62,870.16	-	-	-	62,870.16
存出保证金	832,781.54	-	-	-	832,781.54
交易性金融资产	-	-	-	6,920,794,951.25	6,920,794,951.25
应收清算款	-	-	-	1,536,327.03	1,536,327.03
其他资产	-	-	-	120,080.26	120,080.26
资产总计	6,777,062.66	-	-	6,922,451,358.54	6,929,228,421.20
负债					
应付清算款	-	-	-	1,079,285.32	1,079,285.32
应付管理人报酬	-	-	-	2,978,550.85	2,978,550.85
应付托管费	-	-	-	595,710.16	595,710.16
应交税费	-	-	-	4,075.89	4,075.89
其他负债	-	-	-	887,313.05	887,313.05
负债总计	-	-	-	5,544,935.27	5,544,935.27
利率敏感度缺口	6,777,062.66	-	-	6,916,906,423.27	6,923,683,485.93

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2023年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.01%(2022年12月31日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(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

市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证食品饮料指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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06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	5,345,494,140.33	99.92	6,920,794,951.25	99.96
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	5,345,494,140.33	99.92	6,920,794,951.25	99.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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06月30日	上年度末 2022年12月31日

	业绩比较基准上升5%	264,487,061.32	350,788,423.81
	业绩比较基准下降5%	-264,487,061.32	-350,788,423.81

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	5,342,140,132.63	6,919,311,202.31
第二层次	1,607,487.85	-
第三层次	2,488,573.52	1,483,748.94
合计	5,346,236,194.00	6,920,794,951.25

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2023年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：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	5,345,494,140.33	99.63
	其中：股票	5,345,494,140.33	99.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	742,053.67	0.01
	其中：债券	742,053.67	0.01
	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	18,065,292.54	0.34
8	其他各项资产	925,171.21	0.02
9	合计	5,365,226,657.75	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为123,168,957.00元，占基金资产净值的比例为2.30%。

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	-	-
C	制造业	5,309,493,571.83	99.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	25,522,243.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	6,851,276.00	0.13
	合计	5,341,867,090.83	99.85

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	-	-
C	制造业	3,125,144.32	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00

F	批发和零售业	83,928.25	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	319,009.40	0.01
J	金融业	-	-
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	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,627,049.50	0.07

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	600519	XD贵州茅	326,335	551,832,485.00	10.32
2	000858	五粮液	3,287,569	537,747,661.33	10.05
3	600887	伊利股份	18,403,684	521,192,330.88	9.74
4	000568	泸州老窖	2,310,210	484,150,709.70	9.05
5	600809	山西汾酒	1,531,900	283,508,733.00	5.30
6	002304	洋河股份	1,892,100	248,527,335.00	4.65
7	603288	海天味业	5,236,405	245,325,574.25	4.59

8	000596	古井贡酒	513,000	126,905,940.00	2.37
9	600600	青岛啤酒	1,113,141	115,354,801.83	2.16
10	603369	今世缘	1,969,067	103,966,737.60	1.94
11	603345	安井食品	644,800	94,656,640.00	1.77
12	600702	舍得酒业	732,200	90,756,190.00	1.70
13	000895	双汇发展	3,262,900	79,908,421.00	1.49
14	300146	汤臣倍健	3,202,800	76,803,144.00	1.44
15	300999	金龙鱼	1,872,000	74,861,280.00	1.40
16	600872	中炬高新	1,972,300	72,560,917.00	1.36
17	600132	重庆啤酒	759,600	70,004,736.00	1.31
18	600298	安琪酵母	1,909,200	69,132,132.00	1.29
19	000799	酒鬼酒	714,060	64,372,509.00	1.20
20	002568	百润股份	1,648,220	59,912,797.00	1.12
21	600559	老白干酒	2,297,100	56,301,921.00	1.05
22	603589	口子窖	1,130,100	55,770,435.00	1.04
23	000729	燕京啤酒	4,423,800	55,164,786.00	1.03
24	000860	顺鑫农业	1,629,950	54,913,015.50	1.03
25	603198	迎驾贡酒	753,400	48,066,920.00	0.90
26	002507	涪陵榨菜	2,535,420	46,423,540.20	0.87
27	603517	绝味食品	1,188,900	44,167,635.00	0.83
28	002557	洽洽食品	954,800	39,671,940.00	0.74
29	603156	养元饮品	1,589,000	39,248,300.00	0.73
30	600199	金种子酒	1,651,900	39,216,106.00	0.73
31	603027	千禾味业	1,818,300	38,402,496.00	0.72
32	600779	水井坊	613,100	36,166,769.00	0.68
33	600737	中粮糖业	3,356,800	27,022,240.00	0.51
34	603866	桃李面包	2,510,571	25,406,978.52	0.47
35	002597	金禾实业	1,056,400	24,931,040.00	0.47
36	600197	伊力特	888,872	24,150,652.24	0.45
37	605499	东鹏饮料	138,000	23,860,200.00	0.45
38	600597	光明乳业	2,163,800	22,503,520.00	0.42

39	002216	三全食品	1,379,800	21,497,284.00	0.40
40	600059	古越龙山	2,002,900	20,790,102.00	0.39
41	002847	盐津铺子	242,149	20,594,772.45	0.38
42	603043	广州酒家	713,894	20,174,644.44	0.38
43	002726	龙大美食	2,371,300	19,658,077.00	0.37
44	600305	恒顺醋业	1,746,556	18,967,598.16	0.35
45	002626	金达威	957,400	17,989,546.00	0.34
46	600882	妙可蓝多	806,300	17,964,364.00	0.34
47	000848	承德露露	1,982,280	17,543,178.00	0.33
48	600084	中葡股份	2,116,500	16,233,555.00	0.30
49	600238	海南椰岛	1,407,000	15,673,980.00	0.29
50	002840	华统股份	961,800	15,042,552.00	0.28
51	600073	上海梅林	2,060,500	15,041,650.00	0.28
52	603919	金徽酒	637,400	14,966,152.00	0.28
53	603317	天味食品	1,003,260	14,657,628.60	0.27
54	300973	立高食品	212,500	14,539,250.00	0.27
55	002570	贝因美	3,389,800	14,440,548.00	0.27
56	300765	新诺威	1,102,420	14,210,193.80	0.27
57	000869	张裕A	427,015	13,092,279.90	0.24
58	600186	莲花健康	4,505,800	12,976,704.00	0.24
59	002329	皇氏集团	1,909,800	12,413,700.00	0.23
60	002461	珠江啤酒	1,389,600	12,242,376.00	0.23
61	002646	天佑德酒	890,000	12,006,100.00	0.22
62	600419	天润乳业	703,500	11,410,770.00	0.21
63	605077	华康股份	430,400	11,396,992.00	0.21
64	001215	千味央厨	163,100	10,844,519.00	0.20
65	600300	维维股份	3,552,700	10,800,208.00	0.20
66	600784	鲁银投资	1,484,900	10,750,676.00	0.20
67	003000	劲仔食品	849,600	10,696,464.00	0.20
68	002481	双塔食品	2,323,700	10,363,702.00	0.19
69	300783	三只松鼠	503,500	9,838,390.00	0.18

70	603719	良品铺子	377,700	9,446,277.00	0.18
71	605337	李子园	495,230	9,052,804.40	0.17
72	002991	甘源食品	117,000	8,973,900.00	0.17
73	301206	三元生物	253,900	8,883,961.00	0.17
74	601579	会稽山	752,500	8,871,975.00	0.17
75	001338	永顺泰	472,500	8,712,900.00	0.16
76	002650	加加食品	2,169,600	8,569,920.00	0.16
77	600189	泉阳泉	1,347,110	8,298,197.60	0.16
78	300741	华宝股份	386,752	8,284,227.84	0.15
79	300791	仙乐健康	283,100	8,221,224.00	0.15
80	605338	巴比食品	314,300	7,936,075.00	0.15
81	002946	新乳业	544,100	7,807,835.00	0.15
82	000639	西王食品	1,693,800	7,774,542.00	0.15
83	605016	百龙创园	312,292	7,732,349.92	0.14
84	000505	京粮控股	1,039,200	7,731,648.00	0.14
85	002695	煌上煌	643,700	6,881,153.00	0.13
86	605388	均瑶健康	539,700	6,859,587.00	0.13
87	000833	粤桂股份	1,049,200	6,851,276.00	0.13
88	600429	三元股份	1,429,800	6,820,146.00	0.13
89	688089	嘉必优	226,237	6,741,862.60	0.13
90	603777	来伊份	422,600	6,237,576.00	0.12
91	300829	金丹科技	283,415	5,931,875.95	0.11
92	603711	香飘飘	257,700	5,290,581.00	0.10
93	605089	味知香	129,950	5,107,035.00	0.10
94	603235	天新药业	151,100	4,738,496.00	0.09
95	300997	欢乐家	282,256	4,112,469.92	0.08
96	603237	五芳斋	135,440	4,107,895.20	0.08
97	605300	佳禾食品	188,400	4,095,816.00	0.08
98	001318	阳光乳业	266,000	3,598,980.00	0.07
99	603057	紫燕食品	142,100	3,570,973.00	0.07
100	603170	宝立食品	138,100	2,936,006.00	0.05

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	688582	N芯动	6,476	299,402.44	0.01
2	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
3	688539	高华科技	5,334	231,975.66	0.00
4	688522	纳睿雷达	4,299	221,398.50	0.00
5	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.00
6	688486	龙迅股份	1,887	198,380.31	0.00
7	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
8	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
9	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
10	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
11	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
12	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
13	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
14	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
15	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
16	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
17	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
18	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
19	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
20	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
21	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
22	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
23	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
24	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
25	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00

26	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
27	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
28	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
29	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
30	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
31	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
32	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
33	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
34	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
35	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
36	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
37	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
38	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
39	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
40	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
41	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
42	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
43	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
44	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
45	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
46	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
47	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
48	301397	C溯联	362	14,552.40	0.00
49	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
50	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
51	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
52	301210	N金杨	281	13,816.77	0.00
53	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
54	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
55	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
56	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00

57	688629	C华丰	708	13,161.72	0.00
58	688620	C安凯微	1,016	12,537.44	0.00
59	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
60	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
61	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
62	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
63	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
64	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
65	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
66	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
67	688631	C莱斯	336	10,036.32	0.00
68	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
69	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
70	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
71	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
72	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
73	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
74	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
75	688429	C时创	346	8,833.38	0.00
76	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
77	301170	C锡南	250	8,732.50	0.00
78	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
79	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
80	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
81	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
82	301295	C美硕	215	7,755.05	0.00
83	300804	C广康	226	7,451.22	0.00
84	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
85	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
86	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
87	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00

88	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
89	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
90	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
91	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
92	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
93	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
94	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	600519	贵州茅台	55,951,796.19	0.81
2	600887	伊利股份	33,768,557.72	0.49
3	600809	山西汾酒	32,746,874.41	0.47
4	600737	中粮糖业	27,810,385.48	0.40
5	603288	海天味业	19,136,932.50	0.28
6	603345	安井食品	17,602,133.00	0.25
7	600298	安琪酵母	14,874,162.84	0.21
8	600419	天润乳业	12,970,269.60	0.19
9	600702	舍得酒业	12,293,186.05	0.18
10	600600	青岛啤酒	11,862,010.00	0.17
11	003000	劲仔食品	11,187,484.00	0.16
12	603369	今世缘	10,850,910.00	0.16
13	000568	泸州老窖	10,849,871.00	0.16
14	600784	鲁银投资	10,107,244.00	0.15
15	001338	永顺泰	8,925,590.75	0.13
16	600132	重庆啤酒	7,522,336.00	0.11
17	603866	桃李面包	6,958,553.29	0.10

18	605016	百龙创园	6,958,228.88	0.10
19	600872	中炬高新	6,406,799.94	0.09
20	603589	口子窖	6,323,180.00	0.09

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（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	600519	贵州茅台	183,164,522.80	2.65
2	600887	伊利股份	131,920,657.77	1.91
3	600809	山西汾酒	96,034,015.69	1.39
4	603288	海天味业	65,631,345.78	0.95
5	600702	舍得酒业	31,496,297.00	0.45
6	600600	青岛啤酒	27,361,139.86	0.40
7	603369	今世缘	26,547,377.00	0.38
8	300138	晨光生物	22,434,559.70	0.32
9	000858	五粮液	22,389,890.08	0.32
10	600132	重庆啤酒	20,955,995.64	0.30
11	600872	中炬高新	15,871,757.46	0.23
12	603345	安井食品	15,711,915.33	0.23
13	603589	口子窖	15,574,354.00	0.22
14	600882	妙可蓝多	14,595,184.89	0.21
15	600298	安琪酵母	14,051,892.34	0.20
16	600559	老白干酒	13,882,721.50	0.20
17	600866	星湖科技	13,299,640.00	0.19
18	603517	绝味食品	12,681,426.00	0.18
19	600616	金枫酒业	11,995,388.19	0.17
20	603198	迎驾贡酒	11,483,594.12	0.17

注：本项的"卖出金额"均按卖出成交金额（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	458,497,982.59
卖出股票收入（成交）总额	968,936,181.73

注：本项"买入股票成本"、"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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	742,053.67	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	742,053.67	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111014	李子转债	7,420	742,053.67	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	799,085.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	4,986.90
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	45,483.07
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	925,171.21

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**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002304	洋河股份	210,160.00	0.00	转融通证券出借
2	600809	山西汾酒	185,070.00	0.00	转融通证券出借

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301486	致尚科技	277,921.20	0.01	新股未上市
2	688539	高华科技	231,975.66	0.00	科创板打新限售
3	688522	纳睿雷达	221,398.50	0.00	科创板打新限售
4	688435	英方软件	199,225.84	0.00	科创板打新限售
5	688582	芯动联科	26,360.64	0.00	科创板打新限售

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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

58 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

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		联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

							例
2,858	2,229,494.21	135,166,046.00	2.12%	50,622,111.00	0.79%	6,186,106,300.00	97.08%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中信证券股份有限公司一天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金	6,186,106,300.00	97.08%
2	财信吉祥人寿保险股份有限公司一分红产品	21,000,000.00	0.33%
3	中信建投证券股份有限公司	14,802,776.00	0.23%
4	华泰证券股份有限公司	12,199,429.00	0.19%
5	光大证券资管—光大银行—光大阳光3个月持有期混合型公募基金中基金（FOF）集合资产管理计划	10,866,400.00	0.17%
6	财信吉祥人寿保险股份有限公司—传统产品	10,190,400.00	0.16%
7	招商证券股份有限公司	7,837,211.00	0.12%
8	深圳前海砚博乘风资产管理有限公司—砚博乘风量化8号私募证券投资基金	6,960,400.00	0.11%
9	光大证券资管—光证资管光泽FOF单一资产管理计划—光证资管致远19号单一资产管理计划	5,546,901.00	0.09%
10	光大理财有限责任公司—阳光金36M增利尊享1号	5,284,000.00	0.08%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年09月09日)基金份额总额	326,894,457.00
本报告期期初基金份额总额	7,342,394,457.00
本报告期基金总申购份额	297,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,267,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,371,894,457.00

§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，本基金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

本报告期内，童建林先生任职公司风控负责人，刘荣逵先生任职公司首席信息官，马文辉先生任职公司财务负责人，朱海扬先生不再担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

在本报告截止日至报告批准送出日之间，韩歆毅先生代任公司总经理，郭树强先生不再担任公司总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，未发生涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

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，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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，本基金托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	2	1,043,328,581.30	74.00%	450,008.74	81.78%	-
方正证券	1	19,278,511.35	1.37%	8,314.90	1.51%	-
国联证券	2	1,723,533.39	0.12%	743.13	0.14%	-
天风证券	1	28,632,682.84	2.03%	12,349.96	2.24%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	6	316,972,021.85	22.48%	78,824.36	14.33%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	1,383,085.40	44.03%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,758,000.00	55.97%	-	-	-	-	-	-

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	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-01-11
2	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-01-19
3	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-28
4	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-01-30
5	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-02-24
6	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-03-03
7	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-03-13
8	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-15

9	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2023-03-18
10	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-03-23
11	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2023-03-24
12	天弘基金管理有限公司关于天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-29
13	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-29
14	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
15	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-04-01
16	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-01
17	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-04-03
18	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-04-13
19	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-04-15
20	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-22
21	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-04-27
22	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-05-15
23	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-05-29
24	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-05-31
25	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-06-19

26	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-06-21
----	--------------	-----------	------------

§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
联接基金	1	20230101-20230630	7,168,504,700.00	171,882,900.00	1,154,281,300.00	6,186,106,300.00	97.08%

产品特有风险

基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 时，由此可能导致的特有风险主要包括：

(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；

(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；

(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；

(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

注：1、申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日