

# 银华中证细分食品饮料产业主题交易型开 放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	食品 ETF
场内简称	食品 ETF（扩位证券简称）
基金主代码	159862
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 10 月 26 日
报告期末基金份额总额	63,000,623.00 份
投资目标	本基金采用被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制法跟踪标的指数，即完全按照标的指数的成份股组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而进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红、长期停牌等行为时，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，基金经理将配合使用其他合理的投资方法作为完全复制法的补充，构建本基金实际的投资组合，以追求尽可能贴近标的指数的表现，有效控制跟踪误差。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p>建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金力争实现日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人</p>

	应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产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%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。
业绩比较基准	中证细分食品饮料产业主题指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 10 月 26 日-2021 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	3,703,697.73
2. 本期利润	5,121,265.77
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0331
4. 期末基金资产净值	64,814,613.49
5. 期末基金份额净值	1.0288

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

2、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：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。

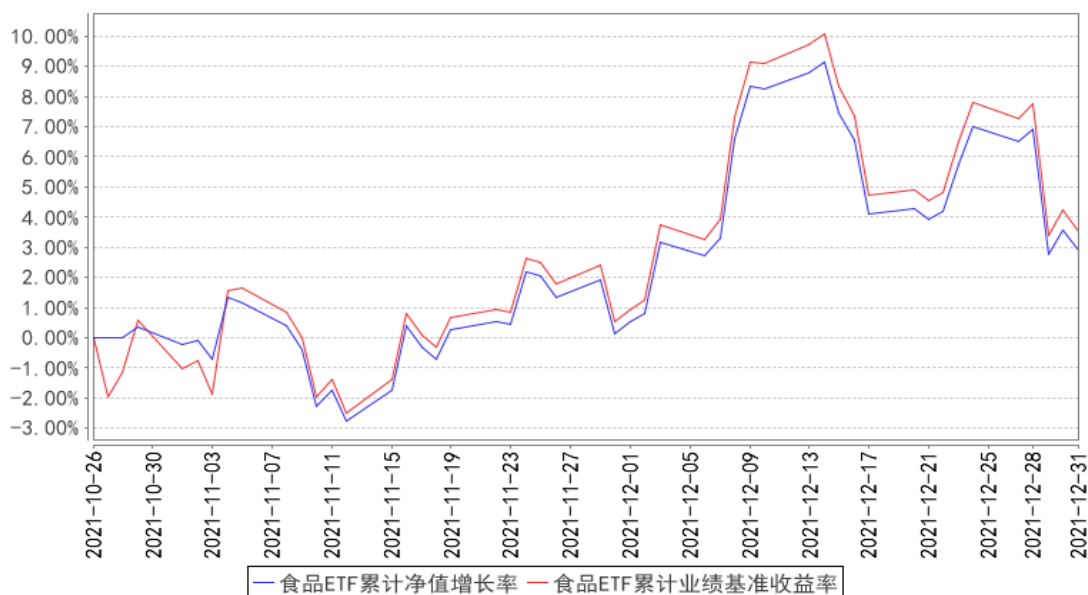
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	净值增长率 ①	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
自基金合同 生效起至今	2.88%	1.24%	3.51%	1.43%	-0.63%	-0.19%

##### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

食品ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同生效日期为 2021 年 10 月 26 日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例应当符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王帅先生	本基金的基金经理	2021 年 10 月 26 日	-	9.5 年	硕士学位。曾就职于泰康资产管理有限责任公司、工银瑞信基金管理有限公司、工银瑞信投资管理有限公司，2018 年 8 月加入银华基金，历任量化投资部基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自 2019 年 6 月 28 日至 2021 年 2 月 25 日担任银华深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 11 月 1 日至 2021 年 5 月 19 日兼任银华中证研发创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2019 年 12 月 6 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 22 日起兼任银华中证 5G 通信主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 3 月 20 日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2020 年 5 月 28

				<p>日起兼任银华中证5G通信主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，自2020年12月10日起兼任银华中证农业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年1月5日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月3日起兼任银华巨潮小盘价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自2021年2月4日起兼任银华中证沪港深500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年2月9日起兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年3月3日起兼任银华中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年3月10日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年4月29日起兼任银华中证基建交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年6月29日起兼任银华中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年10月26日起兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年12月7日起兼任银华中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自2021年12月30日起兼任银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，自2022年1月4日起兼任银华中证现代物流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p>
李宜璇女士	本基金的基金经理	2021年10月26日	-	<p>8年</p> <p>博士学位。曾就职于华龙证券有限责任公司，2014年12月加入银华基金，历任量化投资部量化研究员、基金经理助理，现任量化投资部基金经理。自2017年12月25日起担任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理，自2018年3月7日至2020年12月31日兼任银华恒生中国企业指数分级证券投资基金基金经理，自2018年3月7日至2021年1月13日兼任银华文体娱乐量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自2018年3</p>

				<p>月 7 日至 2021 年 2 月 25 日兼任银华信息科技量化优选股票型发起式证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2018 年 3 月 7 日起兼任银华新能源新材料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2020 年 9 月 29 日起兼任银华工银南方东英标普中国新经济行业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理，自 2020 年 10 月 29 日起兼任银华食品饮料量化优选股票型发起式证券投资基金基金经理，自 2021 年 1 月 1 日起兼任银华恒生中国企业指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理，自 2021 年 1 月 5 日起兼任银华中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 4 日起兼任银华中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 2 月 9 日起兼任银华中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 3 月 10 日起兼任银华中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 5 月 25 日起兼任银华中证港股通消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 6 月 24 日至 2021 年 12 月 21 日兼任银华中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金基金经理，自 2021 年 10 月 26 日起兼任银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。</p>
--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及

基金合同的约定。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 4 季度，人类社会与新冠病毒的斗争依然处于胶着的相持阶段。从海外来看，奥密克戎的扩散正在突破欧美的防控体系，使各国政府不得不再次限制各种经济活动；国内方面，十一假期后的区域性病例在冬季有增多的趋势，在一定程度上影响了居民出行与线下消费。随着上游资源价格的高企与全球供应链的紧张状态，全球尤其是美国的通胀现象正在成为社会经济主要因素。在此背景下，A 股市场在四季度中呈现分化，中小市值类股票获得超额收益。

在报告期内，我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比较验、风险优化等一系列事件，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

展望 2022 年第 1 季度，我们认为疫情与经济活动的相持，仍将是接下来一段时间的主基调。消费需求的复苏进程、全球刺激政策的退出节奏、上游通胀的向下传导速度将是研究市场的核心关注因素。在这一背景下，A 股市场仍将持续出现机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0288 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.88%，业绩比较基准收益率为 3.51%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	62,224,174.11	92.42
	其中：股票	62,224,174.11	92.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,980,723.58	5.91
8	其他资产	1,119,233.63	1.66
9	合计	67,324,131.32	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 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	62,213,955.82	95.99
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		
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		
	合计	62, 213, 955. 82	95. 99

### 5. 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	5, 504. 49	0. 01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业	4, 713. 80	0. 01
F	批发和零售业		
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		
	合计	10, 218. 29	0. 02

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	贵州茅台	4,800	9,840,000.00	15.18
2	000858	五粮液	40,800	9,084,528.00	14.02
3	600887	伊利股份	156,400	6,484,344.00	10.00
4	000568	泸州老窖	22,400	5,686,688.00	8.77
5	600809	山西汾酒	14,949	4,720,595.22	7.28
6	603288	海天味业	38,660	4,063,552.60	6.27
7	002304	洋河股份	18,400	3,031,032.00	4.68
8	000799	酒鬼酒	7,000	1,487,500.00	2.30
9	600132	重庆啤酒	7,400	1,119,768.00	1.73
10	600600	青岛啤酒	10,900	1,079,100.00	1.66

#### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.01
2	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.01

注：本基金本报告期末积极投资仅持有上述股票。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	39,213.01
2	应收证券清算款	1,078,838.02
3	应收股利	-
4	应收利息	1,182.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,119,233.63

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

#### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	001234	泰慕士	5,504.49	0.01	新股流通受限

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票仅上述存在流通受限的情况。

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年10月26日)基金份额总额	324,000,623.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	19,500,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	280,500,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	63,000,623.00

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

注：本基金本报告期内不存在持有基金份额比例达到或者超过 20%的单一投资者的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2021 年 10 月 27 日披露了《银华基金管理股份有限公司关于银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金可投资科创板股票的公告》，本基金基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。

2、本基金管理人于 2021 年 11 月 3 日披露了《银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式

指数证券投资基金上市交易公告书》及《银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》，本基金自 2021 年 11 月 8 日起在深圳证券交易所上市交易，同时开通日常申购、赎回业务。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

9.1.1 银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件

9.1.2 《银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

9.1.3 《银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

9.1.4 《银华中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

9.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

9.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

### 9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

### 9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，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。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2022 年 1 月 21 日