

# 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

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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:2024 年 03 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31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                         | 7  |
| 2.4 信息披露方式                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料                              | 8  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况                 | 8  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 8  |
| 3.2 基金净值表现                              | 9  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 12 |
| §4 管理人报告                                | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14 |
| 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             | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 17 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 18 |
| §5 托管人报告                                | 18 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 18 |
| 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 | 18 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 18 |
| §6 审计报告                                 | 18 |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 18 |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 18 |
| §7 年度财务报表                               | 21 |
| 7.1 资产负债表                               | 21 |
| 7.2 利润表                                 | 23 |
| 7.3 净资产变动表                              | 24 |
| 7.4 报表附注                                | 26 |
| §8 投资组合报告                               | 77 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 77 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 78 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 79 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 85 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 87 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 88 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 88 |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 88 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 88 |
| 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细     | 88 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 8.11 本基金投资股指期货的投资政策.....                 | 88 |
| 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 89 |
| 8.13 投资组合报告附注 .....                      | 89 |
| §9 基金份额持有人信息.....                        | 89 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 89 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 90 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....    | 91 |
| §10 开放式基金份额变动.....                       | 91 |
| §11 重大事件揭示 .....                         | 91 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 91 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 91 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 92 |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                     | 92 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 92 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....       | 92 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....              | 92 |
| 11.8 其他重大事件 .....                        | 94 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 96 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 96 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 96 |
| §13 备查文件目录.....                          | 96 |
| 13.1 备查文件目录 .....                        | 96 |
| 13.2 存放地点.....                           | 97 |
| 13.3 查阅方式.....                           | 97 |

## §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联接基金 |                   |
| 基金简称            | 天弘中证食品饮料ETF联接              |                   |
| 基金主代码           | 001631                     |                   |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                     |                   |
| 基金合同生效日         | 2015年07月29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      | 2,378,927,206.71份          |                   |
| 基金合同存续期         | 不定期                        |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 天弘中证食品饮料ETF联接A             | 天弘中证食品饮料ETF联接C    |
| 下属分级基金的交易代码     | 001631                     | 001632            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 488,909,383.65份            | 1,890,017,823.06份 |

#### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                        |
|--------------|------------------------|
| 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            |
| 基金管理人名称      | 天弘基金管理有限公司             |
| 基金托管人名称      | 中信证券股份有限公司             |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                       |
|------|---------------------------------------|
| 投资目标 | 通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全             |

|        |                                                                                                                                                                                                                     |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%。本基金产品投资策略主要包括目标ETF投资策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略、其他金融工具投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中证食品饮料指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                                     |
| 风险收益特征 | 本基金为ETF联接基金，且目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的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。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，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。                                                                                         |

### 2.2.1 目标基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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 | 中国证券报             |
| 登载基金年度报告正      | www.thfund.com.cn |

|            |                  |
|------------|------------------|
| 文的管理人互联网网址 |                  |
| 基金年度报告备置地点 | 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                        |
|--------|--------------------------|-----------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼     |
| 注册登记机构 | 天弘基金管理有限公司               | 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 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2023年           |                 | 2022年           |                 | 2021年          |                |
|---------------|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------|----------------|----------------|
|               | 天弘中证食品饮料ETF联接A  | 天弘中证食品饮料ETF联接C  | 天弘中证食品饮料ETF联接A  | 天弘中证食品饮料ETF联接C  | 天弘中证食品饮料ETF联接A | 天弘中证食品饮料ETF联接C |
| 本期已实现收益       | -15,591,933.36  | -64,069,098.90  | -74,623,154.23  | -292,422,733.63 | 181,545,322.50 | 484,796,773.24 |
| 本期利润          | -239,772,205.05 | -869,283,530.56 | -242,340,332.86 | -914,074,223.19 | -89,560,142.72 | -37,538,869.91 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.4818         | -0.4817         | -0.4205         | -0.4153         | -0.1750        | -0.0233        |
| 本期加权平均净值利润率   | -17.87%         | -18.20%         | -14.93%         | -14.99%         | -5.28%         | -0.72%         |
| 本期基金份额净值增长率   | -18.01%         | -18.18%         | -13.34%         | -13.52%         | -6.85%         | -7.04%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2023年末          |                 | 2022年末          |                 | 2021年末         |                |

|                     |                      |                      |                      |                      |                      |                      |
|---------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 期末可供分配利润            | 596,655,<br>529.99   | 2,217,98<br>5,116.44 | 723,360,<br>501.35   | 2,399,71<br>0,314.33 | 771,395,<br>162.96   | 2,582,17<br>2,259.27 |
| 期末可供分配基金份额利润        | 1.2204               | 1.1735               | 1.2520               | 1.2099               | 1.3796               | 1.3412               |
| 期末基金资产净值            | 1,153,75<br>8,988.34 | 4,380,82<br>9,727.46 | 1,663,03<br>9,661.81 | 5,618,53<br>8,505.99 | 1,857,22<br>5,080.08 | 6,306,38<br>2,362.98 |
| 期末基金份额净值            | 2.3599               | 2.3179               | 2.8784               | 2.8329               | 3.3216               | 3.2756               |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | 2023年末               |                      | 2022年末               |                      | 2021年末               |                      |
| 基金份额累计净值增长率         | 148.48%              | 144.06%              | 203.07%              | 198.29%              | 249.73%              | 244.90%              |

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

天弘中证食品饮料ETF联接A

| 阶段          | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月       | -7.38%   | 1.06%       | -7.45%     | 1.07%         | 0.07%  | -0.01% |
| 过去六个月       | -8.55%   | 1.10%       | -8.95%     | 1.11%         | 0.40%  | -0.01% |
| 过去一年        | -18.01%  | 1.14%       | -19.43%    | 1.15%         | 1.42%  | -0.01% |
| 过去三年        | -33.82%  | 1.58%       | -36.84%    | 1.59%         | 3.02%  | -0.01% |
| 过去五年        | 105.49%  | 1.59%       | 82.84%     | 1.60%         | 22.65% | -0.01% |
| 自基金合同生效日起至今 | 148.48%  | 1.56%       | 102.95%    | 1.59%         | 45.53% | -0.03% |

## 天弘中证食品饮料ETF联接C

| 阶段                  | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|---------------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月               | -7.42%       | 1.06%               | -7.45%             | 1.07%                     | 0.03%  | -0.01% |
| 过去六个月               | -8.64%       | 1.10%               | -8.95%             | 1.11%                     | 0.31%  | -0.01% |
| 过去一年                | -18.18%      | 1.14%               | -19.43%            | 1.15%                     | 1.25%  | -0.01% |
| 过去三年                | -34.22%      | 1.58%               | -36.84%            | 1.59%                     | 2.62%  | -0.01% |
| 过去五年                | 103.45%      | 1.59%               | 82.84%             | 1.60%                     | 20.61% | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | 144.06%      | 1.56%               | 102.95%            | 1.59%                     | 41.11% | -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ETF联接A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年07月29日-2023年12月31日)



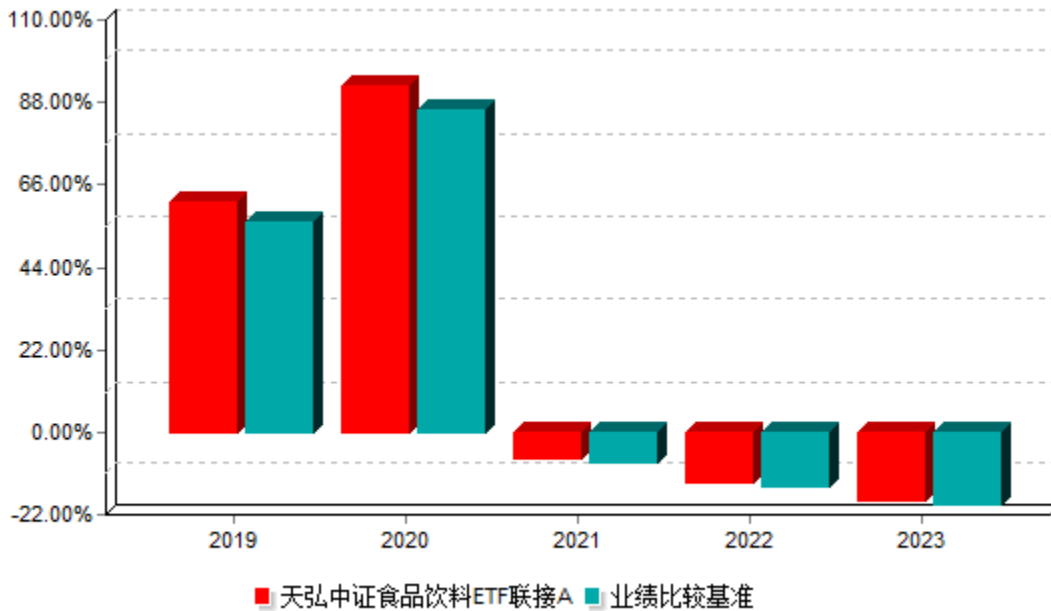
天弘中证食品饮料ETF联接C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年07月29日-2023年12月31日)

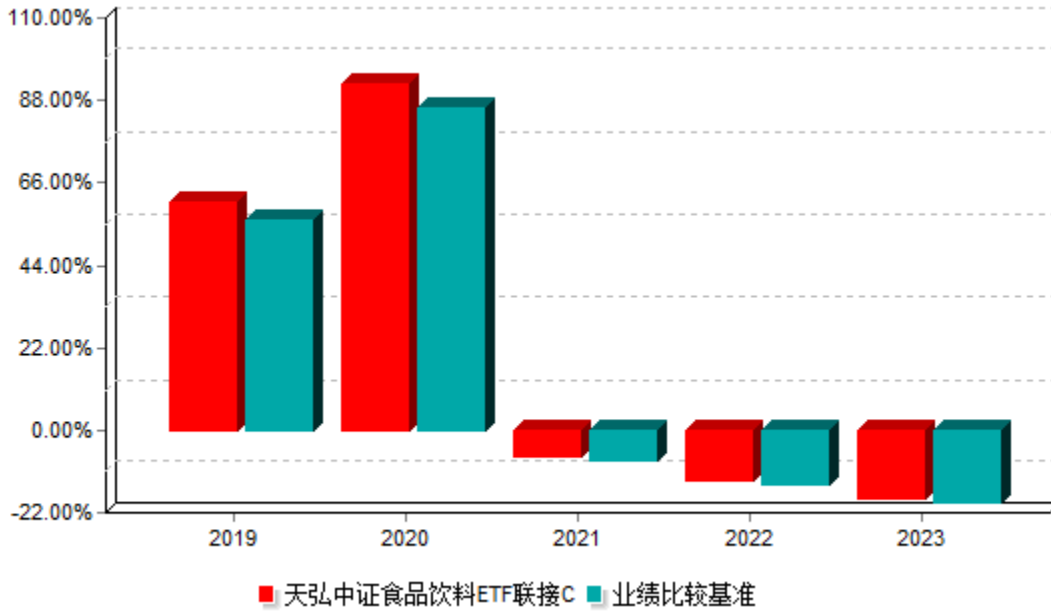


注：1、本基金合同于2015年07月29日生效。

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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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12月31日，公司共管理运作189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11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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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5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年按照基金合同约定将基金资产投资于对应的ETF份额和基准指数成分股，成分股投资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，指数成分股调整导致的结构偏离，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。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年12月31日，天弘中证食品饮料ETF联接A基金份额净值为2.3599元，天弘中证食品饮料ETF联接C基金份额净值为2.3179元。报告期内份额净值增长率天弘中证食品饮料ETF联接A为-18.01%，同期业绩比较基准增长率为-19.43%；天弘中证食品饮料ETF联接C为-18.18%，同期业绩比较基准增长率为-19.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年，大家对经济和A股市场的预期经历了从乐观到悲观的过程。而对于2024年的宏观经济，我觉得可以适当乐观。

2024年，宏观政策会比较积极，叠加2023年下半年的出台政策的效果显现，经济和消费会继续复苏。中央有望打开杠杆空间，赤字率上升；房地产投资降幅收窄，对经济的拖累减少；中美关系有所改善，出口有望修复。

对于A股市场也不必悲观。此前市场较差的表现，主要还是经济复苏不佳导致预期的较大落差。矫枉过正，当前预期又过于悲观，如果未来经济好转，预期再次转向，A股市场会有较好表现。而刺激经济和美联储降息背景下，宽松的流动性也给市场好转提供了必要条件。

食品饮料板块，整体估值较低，但企业经营利润和股价弹性较小，所以其表现可能与市场整体基本一致。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查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合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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联接基金（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联接基金投资运作、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 托管人对本年度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联接基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                     |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见               |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2024)第24882号 |

#### 6.2 审计报告的基本内容

|         |                                     |
|---------|-------------------------------------|
| 审计报告标题  | 审计报告                                |
| 审计报告收件人 | 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全体基金份额持有人 |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>审计意见</p>            | <p>(一)我们审计的内容 我们审计了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ETF联接基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了天弘中证食品饮料ETF联接基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| <p>形成审计意见的基础</p>       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘中证食品饮料ETF联接基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                              |
| <p>强调事项</p>            | <p>无</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <p>其他事项</p>            | <p>无</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <p>其他信息</p>            | <p>无</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>天弘中证食品饮料ETF联接基金的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估天弘中证食品饮料ETF联接基金的持续经营能</p>                                                                                                             |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                        | <p>力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算天弘中证食品饮料ETF联接基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘中证食品饮料ETF联接基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对天弘中证食品饮料ETF联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的</p> |

|           |                                                                                                                                                                                                                      |     |
|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | <p>相关披露：如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘中证食品饮料ETF联接基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |     |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                 |     |
| 注册会计师的姓名  | 张振波                                                                                                                                                                                                                  | 林佳璐 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼                                                                                                                                                                                              |     |
| 审计报告日期    | 2024-03-27                                                                                                                                                                                                           |     |

## §7 年度财务报表

### 7.1 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联接基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 货币资金       | 7.4.7.1 | 308,120,339.19     | 334,949,418.31      |
| 结算备付金      |         | 556,938.84         | 191,753.94          |
| 存出保证金      |         | 567,135.83         | 2,687,563.03        |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 5,243,710,438.60   | 6,947,977,714.40    |
| 其中：股票投资    |         | 228,006,087.36     | 144,402,609.79      |
| 基金投资       |         | 5,015,594,347.86   | 6,759,899,932.10    |
| 债券投资       |         | 110,003.38         | 43,675,172.51       |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 贵金属投资         |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | 154,475.23                 | 1,739,588.64                |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 12,305,262.06              | 23,104,803.82               |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 5,565,414,589.75           | 7,310,650,842.14            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2022年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | 29,540,686.76              | 27,323,189.66               |
| 应付管理人报酬       |            | 224,074.66                 | 211,768.97                  |
| 应付托管费         |            | 44,814.95                  | 42,353.79                   |
| 应付销售服务费       |            | 733,914.10                 | 969,127.45                  |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | 0.07                       | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 7.4.7.6    | 282,383.41                 | 526,234.47                  |
| 负债合计          |            | 30,825,873.95              | 29,072,674.34               |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 7.4.7.7    | 2,378,927,206.71           | 2,561,099,738.86            |
| 未分配利润         | 7.4.7.8    | 3,155,661,509.09           | 4,720,478,428.94            |

|          |  |                  |                  |
|----------|--|------------------|------------------|
| 净资产合计    |  | 5,534,588,715.80 | 7,281,578,167.80 |
| 负债和净资产总计 |  | 5,565,414,589.75 | 7,310,650,842.14 |

注：报告截止日2023年12月31日，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A类基金份额净值2.3599元，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C类基金份额净值2.3179元；基金份额总额2,378,927,206.71份，其中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A类基金份额488,909,383.65份，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C类基金份额1,890,017,823.06份。

## 7.2 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联接基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

| 项目                   | 附注号      | 本期<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2<br>022年12月31日 |
|----------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入              |          | -1,095,977,867.00                 | -1,139,852,319.04                      |
| 1.利息收入               |          | 5,478,724.81                      | 7,069,117.01                           |
| 其中：存款利息收入            | 7.4.7.9  | 5,478,724.81                      | 7,069,117.01                           |
| 债券利息收入               |          | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息<br>收入       |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产<br>收入       |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入               |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填<br>列） |          | -72,563,053.67                    | -359,656,961.53                        |
| 其中：股票投资收益            | 7.4.7.10 | -278,001.19                       | -47,842,009.28                         |
| 基金投资收益               | 7.4.7.11 | -77,107,254.91                    | -316,380,078.95                        |
| 债券投资收益               | 7.4.7.12 | 108,432.47                        | 110,473.25                             |
| 资产支持证券投资<br>收益       | 7.4.7.13 | -                                 | -                                      |

|                            |          |                   |                   |
|----------------------------|----------|-------------------|-------------------|
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.14 | -                 | -                 |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.15 | -                 | -                 |
| 股利收益                       | 7.4.7.16 | 4,713,769.96      | 4,454,653.45      |
| 其他投资收益                     |          | -                 | -                 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.17 | -1,029,394,703.35 | -789,368,668.19   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -                 | -                 |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.18 | 501,165.21        | 2,104,193.67      |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | 13,077,868.61     | 16,562,237.01     |
| 1.管理人报酬                    |          | 2,715,393.98      | 3,416,724.87      |
| 2.托管费                      |          | 543,078.80        | 683,344.90        |
| 3.销售服务费                    |          | 9,579,395.74      | 12,222,167.24     |
| 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                   | 7.4.7.19 | -                 | -                 |
| 7.税金及附加                    |          | 0.09              | -                 |
| 8.其他费用                     | 7.4.7.20 | 240,000.00        | 240,000.00        |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | -1,109,055,735.61 | -1,156,414,556.05 |
| 减：所得税费用                    |          | -                 | -                 |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | -1,109,055,735.61 | -1,156,414,556.05 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -                 | -                 |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | -1,109,055,735.61 | -1,156,414,556.05 |

### 7.3 净资产变动表

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联接基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日      |                   |                   |
|------------------------------------------|------------------------------------|-------------------|-------------------|
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润             | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 2,561,099,738.86                   | 4,720,478,428.94  | 7,281,578,167.80  |
| 二、本期期初净资产                                | 2,561,099,738.86                   | 4,720,478,428.94  | 7,281,578,167.80  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -182,172,532.15                    | -1,564,816,919.85 | -1,746,989,452.00 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | -1,109,055,735.61 | -1,109,055,735.61 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -182,172,532.15                    | -455,761,184.24   | -637,933,716.39   |
| 其中：1.基金申购款                               | 1,600,458,555.97                   | 2,690,300,755.52  | 4,290,759,311.49  |
| 2.基金赎回款                                  | -1,782,631,088.12                  | -3,146,061,939.76 | -4,928,693,027.88 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                  | -                 | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 2,378,927,206.71                   | 3,155,661,509.09  | 5,534,588,715.80  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |                   |                   |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润             | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 2,484,379,077.22                   | 5,679,228,365.84  | 8,163,607,443.06  |

|                                          |                   |                   |                   |
|------------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 产                                        |                   |                   |                   |
| 二、本期期初净资产                                | 2,484,379,077.22  | 5,679,228,365.84  | 8,163,607,443.06  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 76,720,661.64     | -958,749,936.90   | -882,029,275.26   |
| （一）、综合收益总额                               | -                 | -1,156,414,556.05 | -1,156,414,556.05 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | 76,720,661.64     | 197,664,619.15    | 274,385,280.79    |
| 其中：1.基金申购款                               | 3,556,874,198.65  | 6,393,293,809.88  | 9,950,168,008.53  |
| 2.基金赎回款                                  | -3,480,153,537.01 | -6,195,629,190.73 | -9,675,782,727.74 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                 | -                 | -                 |
| 四、本期期末净资产                                | 2,561,099,738.86  | 4,720,478,428.94  | 7,281,578,167.80  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

高阳

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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联接基金(以下简称“本基金”)系由原天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。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。

根据基金管理人天弘基金管理有限公司于2021年11月4日发布《关于天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金变更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并相应修订基金合同的公告》,原天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金变更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,《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基金合同》及其他法律文件自2021年11月4日起生效,原《天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《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联接基金招募说明书》的有关规定,本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异,将基金份额分为不同的类别。其中:在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额。在投资人认购/申购、赎回时不收取认购/申购费、赎回费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金为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“目标ETF”)的联接基金。目标ETF是采用完全复制法实现对中证食品饮料指数紧密跟踪的被动指数基金,本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。

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联接基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以目标ETF基金份额、中证食品饮料指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%;本基金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,应当保持不低于基金资产

净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会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：中证食品饮料指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2024年3月27日批准报出。

#### 7.4.2 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联接基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

#### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量

特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征

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

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、基金投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附

件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| 活期存款   | 308,120,339.19     | 334,949,418.31      |
| 等于：本金  | 307,969,151.30     | 334,783,351.72      |
| 加：应计利息 | 151,187.89         | 166,066.59          |
| 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           | 308,120,339.19 | 334,949,418.31 |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年12月31日  |            |                  |                   |   |
|---------------|---------------------|------------|------------------|-------------------|---|
|               | 成本                  | 应计利息       | 公允价值             | 公允价值变动            |   |
| 股票            | 263,319,314.65      | -          | 228,006,087.36   | -35,313,227.29    |   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -          | -                | -                 |   |
| 债券            | 交易所市场               | 110,000.00 | 3.38             | 110,003.38        | - |
|               | 银行间市场               | -          | -                | -                 | - |
|               | 合计                  | 110,000.00 | 3.38             | 110,003.38        | - |
| 资产支持证券        | -                   | -          | -                | -                 |   |
| 基金            | 6,710,799,346.73    | -          | 5,015,594,347.86 | -1,695,204,998.87 |   |
| 其他            | -                   | -          | -                | -                 |   |
| 合计            | 6,974,228,661.38    | 3.38       | 5,243,710,438.60 | -1,730,518,226.16 |   |
| 项目            | 上年度末<br>2022年12月31日 |            |                  |                   |   |

|               | 成本               | 应计利息       | 公允价值             | 公允价值变动          |
|---------------|------------------|------------|------------------|-----------------|
| 股票            | 138,920,907.43   | -          | 144,402,609.79   | 5,481,702.36    |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                | -          | -                | -               |
| 债券            | 交易所市场            | 869,453.51 | 43,675,172.51    | -28,158.00      |
|               | 银行间市场            | -          | -                | -               |
|               | 合计               | 869,453.51 | 43,675,172.51    | -28,158.00      |
| 资产支持证券        | -                | -          | -                | -               |
| 基金            | 7,466,476,999.27 | -          | 6,759,899,932.10 | -706,577,067.17 |
| 其他            | -                | -          | -                | -               |
| 合计            | 7,648,231,783.70 | 869,453.51 | 6,947,977,714.40 | -701,123,522.81 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 2,082.45           | 3,850.49            |

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| 应付证券出借违约金 | -          | -          |
| 应付交易费用    | 40,300.96  | 282,383.98 |
| 其中：交易所市场  | 40,300.96  | 282,383.98 |
| 银行间市场     | -          | -          |
| 应付利息      | -          | -          |
| 预提费用      | 240,000.00 | 240,000.00 |
| 合计        | 282,383.41 | 526,234.47 |

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 天弘中证食品饮料ETF联接A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(天弘中证食品饮料ETF联接<br>A) | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |                 |
|----------------------------|-------------------------------|-----------------|
|                            | 基金份额（份）                       | 账面金额            |
| 上年度末                       | 577,761,452.82                | 577,761,452.82  |
| 本期申购                       | 154,399,441.06                | 154,399,441.06  |
| 本期赎回（以“-”号填列）              | -243,251,510.23               | -243,251,510.23 |
| 本期末                        | 488,909,383.65                | 488,909,383.65  |

##### 7.4.7.7.2 天弘中证食品饮料ETF联接C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(天弘中证食品饮料ETF联接<br>C) | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |                   |
|----------------------------|-------------------------------|-------------------|
|                            | 基金份额（份）                       | 账面金额              |
| 上年度末                       | 1,983,338,286.04              | 1,983,338,286.04  |
| 本期申购                       | 1,446,059,114.91              | 1,446,059,114.91  |
| 本期赎回（以“-”号填列）              | -1,539,379,577.89             | -1,539,379,577.89 |
| 本期末                        | 1,890,017,823.06              | 1,890,017,823.06  |

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 天弘中证食品饮料ETF联接A

单位：人民币元

| 项目<br>(天弘中证食品饮料ETF<br>F联接A) | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计          |
|-----------------------------|-----------------|-----------------|------------------|
| 上年度末                        | 723,360,501.35  | 361,917,707.64  | 1,085,278,208.99 |
| 本期期初                        | 723,360,501.35  | 361,917,707.64  | 1,085,278,208.99 |
| 本期利润                        | -15,591,933.36  | -224,180,271.69 | -239,772,205.05  |
| 本期基金份额交易产生的变动数              | -111,113,038.00 | -69,543,361.25  | -180,656,399.25  |
| 其中：基金申购款                    | 190,292,407.77  | 74,738,380.24   | 265,030,788.01   |
| 基金赎回款                       | -301,405,445.77 | -144,281,741.49 | -445,687,187.26  |
| 本期已分配利润                     | -               | -               | -                |
| 本期末                         | 596,655,529.99  | 68,194,074.70   | 664,849,604.69   |

## 7.4.7.8.2 天弘中证食品饮料ETF联接C

单位：人民币元

| 项目<br>(天弘中证食品饮料ETF<br>F联接C) | 已实现部分             | 未实现部分            | 未分配利润合计           |
|-----------------------------|-------------------|------------------|-------------------|
| 上年度末                        | 2,399,710,314.33  | 1,235,489,905.62 | 3,635,200,219.95  |
| 本期期初                        | 2,399,710,314.33  | 1,235,489,905.62 | 3,635,200,219.95  |
| 本期利润                        | -64,069,098.90    | -805,214,431.66  | -869,283,530.56   |
| 本期基金份额交易产生的变动数              | -117,656,098.99   | -157,448,686.00  | -275,104,784.99   |
| 其中：基金申购款                    | 1,718,853,990.93  | 706,415,976.58   | 2,425,269,967.51  |
| 基金赎回款                       | -1,836,510,089.92 | -863,864,662.58  | -2,700,374,752.50 |
| 本期已分配利润                     | -                 | -                | -                 |
| 本期末                         | 2,217,985,116.44  | 272,826,787.96   | 2,490,811,904.40  |

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|           | 2023年01月01日至2023年<br>12月31日 | 2022年01月01日至2022年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------|-----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 5,435,399.30                | 6,952,727.75                |
| 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 | 18,178.91                   | 48,539.83                   |
| 其他        | 25,146.60                   | 67,849.43                   |
| 合计        | 5,478,724.81                | 7,069,117.01                |

### 7.4.7.10 股票投资收益

#### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2023年01月01日至202<br>3年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至202<br>2年12月31日 |
|------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 9,240,257.52                      | -3,045,130.16                          |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                                 | -                                      |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -9,518,258.71                     | -44,796,879.12                         |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                                 | -                                      |
| 合计               | -278,001.19                       | -47,842,009.28                         |

#### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 |
|------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 946,446,453.43                    | 1,715,966,164.57                       |
| 减：卖出股票成本总额 | 935,506,854.97                    | 1,715,392,707.34                       |
| 减：交易费用     | 1,699,340.94                      | 3,618,587.39                           |
| 买卖股票差价收入   | 9,240,257.52                      | -3,045,130.16                          |

#### 7.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 |
|-------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 申购基金份额总额    | 361,535,550.00                    | 2,725,197,300.00                       |
| 减：现金支付申购款总额 | 214,975,825.37                    | 1,550,727,038.10                       |
| 减：申购股票成本总额  | 156,077,983.34                    | 1,219,267,141.02                       |
| 减：交易费用      | -                                 | -                                      |
| 申购差价收入      | -9,518,258.71                     | -44,796,879.12                         |

**7.4.7.11 基金投资收益**

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2<br>022年12月31日 |
|-------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额       | 1,218,164,341.50                  | 2,386,459,053.52                       |
| 减：卖出/赎回基金成本总额     | 1,295,259,469.42                  | 2,702,814,566.24                       |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | -                                 | -                                      |
| 减：交易费用            | 12,126.99                         | 24,566.23                              |
| 基金投资收益            | -77,107,254.91                    | -316,380,078.95                        |

**7.4.7.12 债券投资收益****7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                                   | 本期<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 |
|--------------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                         | 84,798.28                         | 123,327.36                             |
| 债券投资收益——买卖债券<br>(债转股及债券到期兑付)<br>差价收入 | 23,634.19                         | -12,854.11                             |
| 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             | 108,432.47 | 110,473.25 |

#### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12月<br>31日 |
|------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 51,116,604.81                     | 6,269,740.30                           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 50,060,455.00                     | 6,133,854.10                           |
| 减：应计利息总额               | 1,032,508.74                      | 148,740.30                             |
| 减：交易费用                 | 6.88                              | 0.01                                   |
| 买卖债券差价收入               | 23,634.19                         | -12,854.11                             |

#### 7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得其他衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年01月01日至2023<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022<br>年12月31日 |
|---------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 4,713,769.96                      | 4,454,653.45                           |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                 | -                                      |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                 | -                                      |
| 合计            | 4,713,769.96                      | 4,454,653.45                           |

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                           | 本期<br>2023年01月01日至2023年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12<br>月31日 |
|--------------------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 1.交易性金融资产                      | -1,029,394,703.35                 | -789,368,668.19                        |
| ——股票投资                         | -40,794,929.65                    | -8,159,279.94                          |
| ——债券投资                         | 28,158.00                         | -16,528.10                             |
| ——资产支持证券投资                     | -                                 | -                                      |
| ——基金投资                         | -988,627,931.70                   | -781,192,860.15                        |
| ——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<br>价值变动产生的预估增<br>值税 | -                                 | -                                      |
| 合计                             | -1,029,394,703.35                 | -789,368,668.19                        |

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|         | 2023年01月01日至2023年<br>12月31日 | 2022年01月01日至2022年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------|-----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 487,372.64                  | 2,060,291.99                |
| 基金转换费收入 | 13,792.57                   | 43,901.68                   |
| 合计      | 501,165.21                  | 2,104,193.67                |

#### 7.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生信用减值损失。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 审计费用    | 120,000.00                        | 120,000.00                             |
| 信息披露费   | 120,000.00                        | 120,000.00                             |
| 证券出借违约金 | -                                 | -                                      |
| 合计      | 240,000.00                        | 240,000.00                             |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

| 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、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 中信证券股份有限公司   | 基金托管人、基金销售机构          |
| 蚂蚁科技集团股份有限公司 | 基金管理人的股东              |
| 天津信托有限责任公司   | 基金管理人的股东              |

|                      |             |
|----------------------|-------------|
| 内蒙古君正能源化工集团股份有限公司    | 基金管理人的股东    |
| 芜湖高新投资有限公司           | 基金管理人的股东    |
| 新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东    |
| 新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东    |
| 新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东    |
| 新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙) | 基金管理人的股东    |
| 天弘创新资产管理有限公司         | 基金管理人的全资子公司 |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称              | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |                          | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |                          |
|--------------------|-------------------------------|--------------------------|------------------------------------|--------------------------|
|                    | 成交金额                          | 占当期<br>股票成<br>交总额<br>的比例 | 成交金额                               | 占当期<br>股票成<br>交总额<br>的比例 |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 278,558,716.70                | 16.95%                   | 16,657,129.85                      | 0.48%                    |

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名 | 本期 |
|------|----|
|------|----|

| 称          | 2023年01月01日至2023年12月31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 | 65,453.29                          | 9.99%      | 15,570.46 | 38.64%       |
| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12月31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 | 7,184.19                           | 0.48%      | -         | -            |

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

| 项目                | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |
|-------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费    | 2,715,393.98                  | 3,416,724.87                       |
| 其中: 应支付销售机构的客户维护费 | 12,397,601.51                 | 14,201,838.19                      |
| 应支付基金管理人的净管理费     | -9,682,207.53                 | -10,785,113.32                     |

注:1、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费, 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余

额(若为负数,则取0)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-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×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。

3、本基金投资于目标ETF的部分不收取管理费,支付销售机构的客户维护费不因投资于目标ETF而调减,因此应支付基金管理人的净管理费为负。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年01月01日至2023<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022<br>年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 543,078.80                        | 683,344.90                             |

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,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扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取0)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-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×该日适用费率/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |                    |            |
|----------------------------|-------------------------------|--------------------|------------|
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费              |                    |            |
|                            | 天弘中证食品饮料ETF联接<br>A            | 天弘中证食品饮料ETF联接<br>C | 合计         |
| 天弘基金<br>管理有限<br>公司         | -                             | 303,278.52         | 303,278.52 |
| 中信证券<br>股份有限               | -                             | 2,576.60           | 2,576.60   |

|                            |                                    |                    |                  |
|----------------------------|------------------------------------|--------------------|------------------|
| 公司                         |                                    |                    |                  |
| 合计                         | -                                  | 305,855.12         | 305,855.12       |
| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |                    |                  |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |                    |                  |
|                            | 天弘中证食品饮料ETF联接<br>A                 | 天弘中证食品饮料ETF联接<br>C | 合计               |
| 天弘基金<br>管理有限<br>公司         | -                                  | 1,272,195.64       | 1,272,195.6<br>4 |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司         | -                                  | 4,354.17           | 4,354.17         |
| 合计                         | -                                  | 1,276,549.81       | 1,276,549.8<br>1 |

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘中证食品饮料ETF联接C按0.20%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘中证食品饮料ETF联接A不收取销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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。

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金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。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12月31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 | 308,120,339.19                | 5,435,399.30 | 334,949,418.31                     | 6,952,727.75 |

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。

#### 7.4.10.7 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

| 关联方名称      | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |           |
|------------|--------|------|------|-------------------------------|-----------|
|            |        |      |      | 基金在承销期内买入<br>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       | 301373 | 凌玮科技 | 网下申购 | 2,764                         | 93,229.72 |

|            |        |      |      |        |            |
|------------|--------|------|------|--------|------------|
| 股份有限公司     |        |      |      |        |            |
| 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       | 001324 | 长青科技 | 网下申购 | 1,131  | 21,353.28  |

|            |        |      |      |        |              |
|------------|--------|------|------|--------|--------------|
| 股份有限公司     |        |      |      |        |              |
| 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    |
| 中信证券股份有限公司 | 688563 | 航材股份 | 网下申购 | 15,010 | 1,185,639.90 |
| 中信证券股份有限公司 | 688450 | 光格科技 | 网下申购 | 1,662  | 88,235.58    |
| 中信证券股份有限公司 | 301371 | 敷尔佳  | 网下申购 | 5,637  | 313,868.16   |
| 中信证券股份有限公司 | 603296 | 华勤技术 | 网下申购 | 5,925  | 478,740.00   |
| 中信证券       | 301558 | 三态股份 | 网下申购 | 14,578 | 106,856.74   |

| 股份有限公司                             |        |      |      |            |              |
|------------------------------------|--------|------|------|------------|--------------|
| 中信证券股份有限公司                         | 301559 | 中集环科 | 网下申购 | 13,144     | 318,347.68   |
| 中信证券股份有限公司                         | 301517 | 陕西华达 | 网下申购 | 1,841      | 49,467.67    |
| 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12月31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    |
| 中信证券股份有限公司                         | 603215 | 比依股份 | 网下申购 | 575        | 7,187.50     |
| 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   |

|                    |        |      |      |         |              |
|--------------------|--------|------|------|---------|--------------|
| 公司                 |        |      |      |         |              |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 001266 | 宏英智能 | 网下申购 | 247     | 9,536.67     |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 688150 | 莱特光电 | 网下申购 | 5,626   | 124,053.30   |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 603209 | 兴通股份 | 网下申购 | 595     | 12,804.40    |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 603051 | 鹿山新材 | 网下申购 | 272     | 7,014.88     |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 301109 | 军信股份 | 网下申购 | 12,250  | 426,422.50   |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 600938 | 中国海油 | 网下申购 | 120,005 | 1,296,054.00 |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 603191 | 望变电气 | 网下申购 | 1,149   | 13,627.14    |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 688290 | 景业智能 | 网下申购 | 3,040   | 103,025.60   |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 301238 | 瑞泰新材 | 网下申购 | 34,966  | 670,647.88   |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 688349 | 三一重能 | 网下申购 | 32,650  | 972,970.00   |
| 中信证券<br>股份有限       | 301302 | 华如科技 | 网下申购 | 4,651   | 241,991.53   |

|            |        |      |      |        |              |
|------------|--------|------|------|--------|--------------|
| 公司         |        |      |      |        |              |
| 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   |
| 中信证券股份有限公司 | 603235 | 天新药业 | 网下申购 | 572    | 21,095.36    |
| 中信证券股份有限公司 | 301269 | 华大九天 | 网下申购 | 11,677 | 381,721.13   |
| 中信证券股份有限公司 | 688041 | 海光信息 | 网下申购 | 70,208 | 2,527,488.00 |
| 中信证券股份有限公司 | 001339 | 智微智能 | 网下申购 | 812    | 13,690.32    |
| 中信证券股份有限公司 | 301171 | 易点天下 | 网下申购 | 9,845  | 178,982.10   |
| 中信证券股份有限公司 | 688271 | 联影医疗 | 网下申购 | 7,365  | 809,266.20   |
| 中信证券股份有限公司 | 688439 | 振华风光 | 网下申购 | 7,096  | 475,361.04   |
| 中信证券股份有限公司 | 301296 | 新巨丰  | 网下申购 | 10,411 | 189,376.09   |

|            |        |      |      |        |            |
|------------|--------|------|------|--------|------------|
| 公司         |        |      |      |        |            |
| 中信证券股份有限公司 | 301349 | 信德新材 | 网下申购 | 1,798  | 249,706.24 |
| 中信证券股份有限公司 | 688114 | 华大智造 | 网下申购 | 5,336  | 465,192.48 |
| 中信证券股份有限公司 | 688409 | 富创精密 | 网下申购 | 6,334  | 443,316.66 |
| 中信证券股份有限公司 | 603151 | 邦基科技 | 网下申购 | 535    | 9,603.25   |
| 中信证券股份有限公司 | 001322 | 箭牌家居 | 网下申购 | 1,595  | 20,224.60  |
| 中信证券股份有限公司 | 301230 | 泓博医药 | 网下申购 | 2,687  | 107,480.00 |
| 中信证券股份有限公司 | 688432 | 有研硅  | 网下申购 | 20,044 | 198,636.04 |
| 中信证券股份有限公司 | 301165 | 锐捷网络 | 网下申购 | 10,769 | 348,700.22 |
| 中信证券股份有限公司 | 688141 | 杰华特  | 网下申购 | 9,946  | 380,533.96 |

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有6,576,966,100.00份目标ETF基金份额（上年度末：7,168,504,700.00份），占其总份额的比例为94.01%（上年度末：97.63%）。

#### 7.4.11 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。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |     |         |       |        |          |            |           |    |
|----------------------|------|------------|-----|---------|-------|--------|----------|------------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期 | 流通受限类型  | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额     | 期末估值总额    | 备注 |
| 688563               | 航材股份 | 2023-07-12 | 6个月 | 科创板打新限售 | 78.99 | 60.49  | 1,501    | 118,563.99 | 90,795.49 | -  |
| 688548               | 广钢气体 | 2023-08-08 | 6个月 | 科创板打新限售 | 9.87  | 12.75  | 4,048    | 39,953.76  | 51,612.00 | -  |
| 603296               | 华勤技术 | 2023-08-01 | 6个月 | 新股锁定    | 80.80 | 77.75  | 593      | 47,914.40  | 46,105.75 | -  |
| 301526               | C国际复 | 2023-12-19 | 6个月 | 创业板打新限售 | 2.66  | 4.45   | 9,723    | 25,863.18  | 43,267.35 | -  |
| 301487               | 盟固利  | 2023-08-01 | 6个月 | 创业板打新限售 | 5.32  | 40.96  | 867      | 4,612.44   | 35,512.32 | -  |
| 688549               | 中巨芯  | 2023-08-30 | 6个月 | 科创板打新限售 | 5.18  | 8.09   | 4,294    | 22,242.92  | 34,738.46 | -  |
| 301348               | 蓝箭电子 | 2023-08-01 | 6个月 | 创业板打    | 18.08 | 44.57  | 613      | 11,083.04  | 27,321.41 | -  |

|        |      |            |     |         |       |       |       |           |           |   |  |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|--|
|        |      | 1          |     | 新限售     |       |       |       |           |           |   |  |
| 688702 | 盛科通信 | 2023-09-06 | 6个月 | 科创板打新限售 | 42.66 | 48.18 | 549   | 23,420.34 | 26,450.82 | - |  |
| 688582 | 芯动联科 | 2023-06-21 | 6个月 | 科创板打新限售 | 26.74 | 38.67 | 648   | 17,327.52 | 25,058.16 | - |  |
| 301559 | 中集环科 | 2023-09-26 | 6个月 | 创业板打新限售 | 24.22 | 18.24 | 1,315 | 31,849.30 | 23,985.60 | - |  |
| 301486 | 致尚科技 | 2023-06-30 | 6个月 | 创业板打新限售 | 57.66 | 47.25 | 482   | 27,792.12 | 22,774.50 | - |  |
| 688652 | 京仪装备 | 2023-11-22 | 6个月 | 科创板打新限售 | 31.95 | 52.25 | 416   | 13,291.20 | 21,736.00 | - |  |
| 301525 | 儒竞科技 | 2023-08-23 | 6个月 | 创业板打新限售 | 99.57 | 81.46 | 266   | 26,485.62 | 21,668.36 | - |  |
| 301498 | 乖宝宠物 | 2023-08-09 | 6个月 | 创业板打新限售 | 39.99 | 38.81 | 554   | 22,154.46 | 21,500.74 | - |  |
| 301371 | 敷尔佳  | 2023-07-24 | 6个月 | 创业板打新限售 | 55.68 | 37.58 | 564   | 31,403.52 | 21,195.12 | - |  |

|        |      |            |     |         |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 301370 | 国科恒泰 | 2023-07-03 | 6个月 | 创业板打新限售 | 13.39 | 16.01 | 1,240 | 16,603.60 | 19,852.40 | - |
| 301421 | 波长光电 | 2023-08-16 | 6个月 | 创业板打新限售 | 29.38 | 59.37 | 332   | 9,754.16  | 19,710.84 | - |
| 301558 | 三态股份 | 2023-09-21 | 6个月 | 创业板打新限售 | 7.33  | 13.40 | 1,458 | 10,687.14 | 19,537.20 | - |
| 688627 | 精智达  | 2023-07-11 | 6个月 | 科创板打新限售 | 46.77 | 87.72 | 222   | 10,382.94 | 19,473.84 | - |
| 688591 | 泰凌微  | 2023-08-18 | 6个月 | 科创板打新限售 | 24.98 | 28.02 | 681   | 17,011.38 | 19,081.62 | - |
| 300904 | 威力传动 | 2023-08-02 | 6个月 | 创业板打新限售 | 35.41 | 61.53 | 304   | 10,764.64 | 18,705.12 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023-06-26 | 6个月 | 创业板打新限售 | 39.78 | 69.09 | 262   | 10,422.36 | 18,101.58 | - |
| 301381 | 赛维时代 | 2023-07-05 | 6个月 | 创业板打新限售 | 20.45 | 29.69 | 571   | 11,676.95 | 16,952.99 | - |
| 301172 | 君逸   | 2023-07-11 | 6个月 | 创业      | 31.33 | 38.16 | 438   | 13,722.54 | 16,714.08 | - |

|            |          |                    |     |                 |       |       |       |               |               |   |  |
|------------|----------|--------------------|-----|-----------------|-------|-------|-------|---------------|---------------|---|--|
|            | 数码       | 9                  |     | 板打<br>新限售       |       |       |       |               |               |   |  |
| 3015<br>09 | 金凯<br>生科 | 2023<br>-07-2<br>6 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限售 | 56.56 | 62.23 | 266   | 15,04<br>4.96 | 16,55<br>3.18 | - |  |
| 6886<br>12 | 威迈<br>斯  | 2023<br>-07-1<br>9 | 6个月 | 科创<br>板打<br>新限售 | 47.29 | 37.97 | 422   | 19,95<br>6.38 | 16,02<br>3.34 | - |  |
| 6010<br>96 | 宏盛<br>华源 | 2023<br>-12-1<br>5 | 6个月 | 新股<br>锁定        | 1.70  | 4.06  | 3,918 | 6,66<br>0.60  | 15,90<br>7.08 | - |  |
| 3013<br>93 | 昊帆<br>生物 | 2023<br>-07-0<br>5 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限售 | 67.68 | 59.37 | 260   | 17,59<br>6.80 | 15,43<br>6.20 | - |  |
| 6010<br>83 | 锦江<br>航运 | 2023<br>-11-2<br>8 | 6个月 | 新股<br>锁定        | 11.25 | 11.07 | 1,263 | 14,20<br>8.75 | 13,98<br>1.41 | - |  |
| 3015<br>10 | 固高<br>科技 | 2023<br>-08-0<br>4 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限售 | 12.00 | 35.01 | 396   | 4,75<br>2.00  | 13,86<br>3.96 | - |  |
| 3015<br>07 | 民生<br>健康 | 2023<br>-08-2<br>4 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限售 | 10.00 | 15.85 | 851   | 8,51<br>0.00  | 13,48<br>8.35 | - |  |
| 3012<br>10 | 金杨<br>股份 | 2023<br>-06-2<br>1 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限售 | 57.88 | 45.48 | 281   | 16,26<br>4.28 | 12,77<br>9.88 | - |  |
| 3015       | N达       | 2023               | 6个月 | 创业              | 8.90  | 22.14 | 576   | 5,12          | 12,75         | - |  |

|            |          |                    |     |                     |       |       |       |               |               |   |
|------------|----------|--------------------|-----|---------------------|-------|-------|-------|---------------|---------------|---|
| 66         | 利        | -12-2<br>2         |     | 板打<br>新限<br>售       |       |       |       | 6.40          | 2.64          |   |
| 3014<br>56 | 盘古<br>智能 | 2023<br>-07-0<br>6 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 37.96 | 30.39 | 407   | 15,44<br>9.72 | 12,36<br>8.73 | - |
| 6886<br>02 | 康鹏<br>科技 | 2023<br>-07-1<br>3 | 6个月 | 科创<br>板打<br>新限<br>售 | 8.66  | 11.06 | 1,066 | 9,23<br>1.56  | 11,78<br>9.96 | - |
| 6887<br>19 | 爱科<br>赛博 | 2023<br>-09-2<br>0 | 6个月 | 科创<br>板打<br>新限<br>售 | 69.98 | 60.10 | 194   | 13,57<br>6.12 | 11,65<br>9.40 | - |
| 3015<br>50 | 斯菱<br>股份 | 2023<br>-09-0<br>6 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 37.56 | 43.57 | 260   | 9,76<br>5.60  | 11,32<br>8.20 | - |
| 3012<br>92 | 海科<br>新源 | 2023<br>-06-2<br>9 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 19.99 | 19.35 | 583   | 11,65<br>4.17 | 11,28<br>1.05 | - |
| 3015<br>08 | 中机<br>认检 | 2023<br>-11-2<br>3 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 16.82 | 26.68 | 419   | 7,04<br>7.58  | 11,17<br>8.92 | - |
| 3012<br>51 | 威尔<br>高  | 2023<br>-08-3<br>0 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 28.88 | 34.59 | 321   | 9,27<br>0.48  | 11,10<br>3.39 | - |
| 6885<br>92 | 司南<br>导航 | 2023<br>-08-0<br>7 | 6个月 | 科创<br>板打<br>新限      | 50.50 | 50.53 | 216   | 10,90<br>8.00 | 10,91<br>4.48 | - |

|        |      |            |     |         |       |       |     |           |           |   |  |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|--|
|        |      |            |     | 售       |       |       |     |           |           |   |  |
| 301499 | 维科精密 | 2023-07-13 | 6个月 | 创业板打新限售 | 19.50 | 28.93 | 371 | 7,234.50  | 10,733.03 | - |  |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 6个月 | 科创板打新限售 | 55.00 | 74.14 | 140 | 7,700.00  | 10,379.60 | - |  |
| 688653 | 康希通信 | 2023-11-10 | 6个月 | 科创板打新限售 | 10.50 | 15.99 | 648 | 6,804.00  | 10,361.52 | - |  |
| 301528 | 多浦乐  | 2023-08-17 | 6个月 | 创业板打新限售 | 71.80 | 68.91 | 148 | 10,626.40 | 10,198.68 | - |  |
| 301329 | 信音电子 | 2023-07-05 | 6个月 | 创业板打新限售 | 21.00 | 22.23 | 458 | 9,618.00  | 10,181.34 | - |  |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 6个月 | 创业板打新限售 | 36.90 | 50.85 | 198 | 7,306.20  | 10,068.30 | - |  |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 6个月 | 创业板打新限售 | 25.82 | 31.80 | 306 | 7,900.92  | 9,730.80  | - |  |
| 301395 | 仁信新材 | 2023-06-21 | 6个月 | 创业板打新限售 | 26.68 | 18.69 | 520 | 13,873.60 | 9,718.80  | - |  |

|        |      |            |     |         |       |       |     |           |          |   |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-----|-----------|----------|---|
| 688716 | 中研股份 | 2023-09-13 | 6个月 | 科创板打新限售 | 29.66 | 36.39 | 267 | 7,919.22  | 9,716.13 | - |
| 301413 | 安培龙  | 2023-12-11 | 6个月 | 创业板打新限售 | 33.25 | 58.19 | 164 | 5,453.00  | 9,543.16 | - |
| 301500 | 飞南资源 | 2023-09-13 | 6个月 | 创业板打新限售 | 23.97 | 20.89 | 455 | 10,906.35 | 9,504.95 | - |
| 301418 | 协昌科技 | 2023-08-10 | 6个月 | 创业板打新限售 | 51.88 | 50.20 | 189 | 9,805.32  | 9,487.80 | - |
| 301516 | 中远通  | 2023-12-01 | 6个月 | 创业板打新限售 | 6.87  | 15.51 | 604 | 4,149.48  | 9,368.04 | - |
| 301272 | 英华特  | 2023-07-06 | 6个月 | 创业板打新限售 | 51.39 | 53.38 | 173 | 8,890.47  | 9,234.74 | - |
| 301469 | 恒达新材 | 2023-08-10 | 6个月 | 创业板打新限售 | 36.58 | 33.09 | 275 | 10,059.50 | 9,099.75 | - |
| 301519 | 舜禹股份 | 2023-07-19 | 6个月 | 创业板打新限售 | 20.93 | 20.21 | 442 | 9,251.06  | 8,932.82 | - |
| 301518 | 长华   | 2023-07-2  | 6个月 | 创业      | 25.75 | 23.01 | 385 | 9,913.75  | 8,858.85 | - |

|            |          |                    |     |                     |       |       |     |               |              |   |  |
|------------|----------|--------------------|-----|---------------------|-------|-------|-----|---------------|--------------|---|--|
|            | 化学       | 6                  |     | 板打<br>新限<br>售       |       |       |     |               |              |   |  |
| 3015<br>68 | 思泰<br>克  | 2023<br>-11-2<br>1 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 23.23 | 35.58 | 246 | 5,71<br>4.58  | 8,75<br>2.68 | - |  |
| 3015<br>20 | 万邦<br>医药 | 2023<br>-09-1<br>8 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 67.88 | 52.74 | 160 | 10,86<br>0.80 | 8,43<br>8.40 | - |  |
| 3014<br>59 | 丰茂<br>股份 | 2023<br>-12-0<br>6 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 31.90 | 39.84 | 208 | 6,63<br>5.20  | 8,28<br>6.72 | - |  |
| 6887<br>20 | 艾森<br>股份 | 2023<br>-11-2<br>9 | 6个月 | 科创<br>板打<br>新限<br>售 | 28.03 | 49.84 | 165 | 4,62<br>4.95  | 8,22<br>3.60 | - |  |
| 6885<br>73 | 信宇<br>人  | 2023<br>-08-0<br>9 | 6个月 | 科创<br>板打<br>新限<br>售 | 23.68 | 28.80 | 285 | 6,74<br>8.80  | 8,20<br>8.00 | - |  |
| 3014<br>89 | 思泉<br>新材 | 2023<br>-10-1<br>6 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限<br>售 | 41.66 | 64.11 | 128 | 5,33<br>2.48  | 8,20<br>6.08 | - |  |
| 6886<br>51 | 盛邦<br>安全 | 2023<br>-07-1<br>9 | 6个月 | 科创<br>板打<br>新限<br>售 | 39.90 | 46.05 | 178 | 7,10<br>2.20  | 8,19<br>6.90 | - |  |
| 3015<br>17 | 陕西<br>华达 | 2023<br>-10-0<br>9 | 6个月 | 创业<br>板打<br>新限      | 26.87 | 43.69 | 185 | 4,97<br>0.95  | 8,08<br>2.65 | - |  |

|        |      |            |     |         |        |       |     |           |          |   |  |
|--------|------|------------|-----|---------|--------|-------|-----|-----------|----------|---|--|
|        |      |            |     | 售       |        |       |     |           |          |   |  |
| 301578 | C辰奕  | 2023-12-21 | 6个月 | 创业板打新限售 | 48.94  | 68.32 | 118 | 5,774.92  | 8,061.76 | - |  |
| 301548 | 崇德科技 | 2023-09-11 | 6个月 | 创业板打新限售 | 66.80  | 58.99 | 136 | 9,084.80  | 8,022.64 | - |  |
| 688657 | 浩辰软件 | 2023-09-25 | 6个月 | 科创板打新限售 | 103.40 | 78.23 | 101 | 10,443.40 | 7,901.23 | - |  |
| 688646 | 逸飞激光 | 2023-07-21 | 6个月 | 科创板打新限售 | 46.80  | 36.07 | 219 | 10,249.20 | 7,899.33 | - |  |
| 688671 | 碧兴物联 | 2023-08-02 | 6个月 | 科创板打新限售 | 36.12  | 34.30 | 226 | 8,163.12  | 7,751.80 | - |  |
| 688693 | 锆威特  | 2023-08-10 | 6个月 | 科创板打新限售 | 40.83  | 43.41 | 178 | 7,267.74  | 7,726.98 | - |  |
| 603275 | 众辰科技 | 2023-08-16 | 6个月 | 新股锁定    | 49.97  | 39.70 | 193 | 9,644.21  | 7,662.10 | - |  |
| 301533 | 威马农机 | 2023-08-07 | 6个月 | 创业板打新限售 | 29.50  | 33.16 | 225 | 6,637.50  | 7,461.00 | - |  |
| 603062 | 麦加芯彩 | 2023-10-3  | 6个月 | 新股锁定    | 58.08  | 57.81 | 126 | 7,318.08  | 7,284.06 | - |  |

|        |      |            |     |         |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
|        |      | 1          |     |         |       |       |     |          |          |   |
| 301555 | 惠柏新材 | 2023-10-24 | 6个月 | 创业板打新限售 | 22.88 | 32.44 | 224 | 5,125.12 | 7,266.56 | - |
| 301505 | 苏州规划 | 2023-07-12 | 6个月 | 创业板打新限售 | 26.35 | 35.81 | 194 | 5,111.90 | 6,947.14 | - |
| 301529 | 福赛科技 | 2023-08-31 | 6个月 | 创业板打新限售 | 36.60 | 37.88 | 182 | 6,661.20 | 6,894.16 | - |
| 301515 | 港通医疗 | 2023-07-13 | 6个月 | 创业板打新限售 | 31.16 | 28.27 | 230 | 7,166.80 | 6,502.10 | - |
| 688648 | 中邮科技 | 2023-11-06 | 6个月 | 科创板打新限售 | 15.18 | 21.43 | 303 | 4,599.54 | 6,493.29 | - |
| 688450 | 光格科技 | 2023-07-17 | 6个月 | 科创板打新限售 | 53.09 | 36.42 | 167 | 8,866.03 | 6,082.14 | - |
| 603004 | C鼎龙  | 2023-12-20 | 6个月 | 新股锁定    | 16.80 | 31.19 | 195 | 3,276.00 | 6,082.05 | - |
| 603270 | 金帝股份 | 2023-08-25 | 6个月 | 新股锁定    | 21.77 | 29.58 | 195 | 4,245.15 | 5,768.10 | - |
| 603119 | 浙江荣泰 | 2023-07-21 | 6个月 | 新股锁定    | 15.32 | 23.87 | 226 | 3,462.32 | 5,394.62 | - |

| 603107               | 上海汽配 | 2023-10-25 | 6个月 | 新股锁定   | 14.23 | 18.19  | 292          | 4,155.16 | 5,311.48 | -  |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|--------------|----------|----------|----|
| 603193               | 润本股份 | 2023-10-09 | 6个月 | 新股锁定   | 17.38 | 16.66  | 303          | 5,266.14 | 5,047.98 | -  |
| 001306               | 夏厦精密 | 2023-11-09 | 6个月 | 新股锁定   | 53.63 | 75.36  | 64           | 3,432.32 | 4,823.04 | -  |
| 001326               | 联域股份 | 2023-11-01 | 6个月 | 新股锁定   | 41.18 | 48.64  | 99           | 4,076.82 | 4,815.36 | -  |
| 603075               | 热威股份 | 2023-09-01 | 6个月 | 新股锁定   | 23.10 | 23.31  | 182          | 4,204.20 | 4,242.42 | -  |
| 001358               | 兴欣新材 | 2023-12-14 | 6个月 | 新股锁定   | 41.00 | 44.16  | 87           | 3,567.00 | 3,841.92 | -  |
| 001239               | 永达股份 | 2023-12-04 | 6个月 | 新股锁定   | 12.05 | 19.92  | 189          | 2,277.45 | 3,764.88 | -  |
| 603231               | 索宝蛋白 | 2023-12-06 | 6个月 | 新股锁定   | 21.29 | 21.53  | 161          | 3,427.69 | 3,466.33 | -  |
| 603273               | 天元智能 | 2023-10-16 | 6个月 | 新股锁定   | 9.50  | 18.97  | 178          | 1,691.00 | 3,376.66 | -  |
| 603276               | 恒兴新材 | 2023-09-18 | 6个月 | 新股锁定   | 25.73 | 24.88  | 134          | 3,447.82 | 3,333.92 | -  |
| 603373               | 安邦护卫 | 2023-12-13 | 6个月 | 新股锁定   | 19.10 | 34.75  | 88           | 1,680.80 | 3,058.00 | -  |
| 7.4.12.1.2 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<br>(单位:张) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |

|            |          |                    |             |               |            |            |       |                |                |   |
|------------|----------|--------------------|-------------|---------------|------------|------------|-------|----------------|----------------|---|
| 1110<br>18 | 华康<br>转债 | 2023<br>-12-2<br>5 | 1个月内<br>(含) | 新债<br>未上<br>市 | 100.0<br>0 | 100.0<br>0 | 1,100 | 110,0<br>00.00 | 110,0<br>03.38 | - |
|------------|----------|--------------------|-------------|---------------|------------|------------|-------|----------------|----------------|---|

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

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以风险委员会为核心的、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。在董事会下设立风险委员会，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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | 43,675,172.51       |
| 合计     | -                  | 43,675,172.51       |

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金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。

#### 7.4.13.2.3 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。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | -                  | -                   |
| AAA以下  | 110,003.38         | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 110,003.38         | -                   |

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金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。

#### 7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2023年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2023年12月31日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计             |
|--------------------|----------------|------|------|-----|----------------|
| 资产                 |                |      |      |     |                |
| 货币资金               | 308,120,339.19 | -    | -    | -   | 308,120,339.19 |
| 结算备付金              | 556,938.84     | -    | -    | -   | 556,938.84     |

|                     |                |      |            |                  |                  |
|---------------------|----------------|------|------------|------------------|------------------|
| 存出保证金               | 567,135.83     | -    | -          | -                | 567,135.83       |
| 交易性金融资产             | -              | -    | 110,003.38 | 5,243,600,435.22 | 5,243,710,438.60 |
| 应收清算款               | -              | -    | -          | 154,475.23       | 154,475.23       |
| 应收申购款               | -              | -    | -          | 12,305,262.06    | 12,305,262.06    |
| 资产总计                | 309,244,413.86 | -    | 110,003.38 | 5,256,060,172.51 | 5,565,414,589.75 |
| 负债                  |                |      |            |                  |                  |
| 应付赎回款               | -              | -    | -          | 29,540,686.76    | 29,540,686.76    |
| 应付管理人报酬             | -              | -    | -          | 224,074.66       | 224,074.66       |
| 应付托管费               | -              | -    | -          | 44,814.95        | 44,814.95        |
| 应付销售服务费             | -              | -    | -          | 733,914.10       | 733,914.10       |
| 应交税费                | -              | -    | -          | 0.07             | 0.07             |
| 其他负债                | -              | -    | -          | 282,383.41       | 282,383.41       |
| 负债总计                | -              | -    | -          | 30,825,873.95    | 30,825,873.95    |
| 利率敏感度缺口             | 309,244,413.86 | -    | 110,003.38 | 5,225,234,298.56 | 5,534,588,715.80 |
| 上年度末<br>2022年12月31日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上       | 不计息              | 合计               |
| 资产                  |                |      |            |                  |                  |
| 货币资金                | 334,949,418.31 | -    | -          | -                | 334,949,418.31   |
| 结算备付金               | 191,753.94     | -    | -          | -                | 191,753.94       |
| 存出保证金               | 2,687,563.03   | -    | -          | -                | 2,687,563.03     |
| 交易性金融资产             | 43,675,172.51  | -    | -          | 6,904,302,541.89 | 6,947,977,714.40 |
| 应收清算款               | -              | -    | -          | 1,739,588.64     | 1,739,588.64     |
| 应收申购款               | -              | -    | -          | 23,104,803.82    | 23,104,803.82    |
| 资产总计                | 381,503,907.79 | -    | -          | 6,929,146,934.35 | 7,310,650,842.14 |
| 负债                  |                |      |            |                  |                  |
| 应付赎回款               | -              | -    | -          | 27,323,189.66    | 27,323,189.66    |
| 应付管理人报酬             | -              | -    | -          | 211,768.97       | 211,768.97       |
| 应付托管费               | -              | -    | -          | 42,353.79        | 42,353.79        |
| 应付销售服务费             | -              | -    | -          | 969,127.45       | 969,127.45       |
| 其他负债                | -              | -    | -          | 526,234.47       | 526,234.47       |

|         |                |   |   |                  |                  |
|---------|----------------|---|---|------------------|------------------|
| 负债总计    | -              | - | - | 29,072,674.34    | 29,072,674.34    |
| 利率敏感度缺口 | 381,503,907.79 | - | - | 6,900,074,260.01 | 7,281,578,167.80 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年12月31日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.00%(2022年12月31日：0.60%)，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)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标ETF份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2023年12月31日 |                          | 上年度末<br>2022年12月31日 |                          |
|--------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|        | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资 | 228,006,087.36     | 4.12                     | 144,402,609.79      | 1.98                     |

|               |                  |       |                  |       |
|---------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 产—股票投资        |                  |       |                  |       |
| 交易性金融资产—基金投资  | 5,015,594,347.86 | 90.62 | 6,759,899,932.10 | 92.84 |
| 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            | 5,243,600,435.22 | 94.74 | 6,904,302,541.89 | 94.82 |

#### 7.4.13.4.3.2 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<br>2023年12月31日          | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|    | 业绩比较基准上升5%           | 275,182,561.56              | 363,423,566.35      |
|    | 业绩比较基准下降5%           | -275,182,561.56             | -363,423,566.35     |

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2023年12月31日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
|               |                    |                     |

|      |                  |                  |
|------|------------------|------------------|
| 第一层次 | 5,242,292,376.91 | 6,903,133,334.67 |
| 第二层次 | 110,003.38       | 43,675,172.51    |
| 第三层次 | 1,308,058.31     | 1,169,207.22     |
| 合计   | 5,243,710,438.60 | 6,947,977,714.40 |

#### 7.4.14.2.2 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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |              |              |
|----------------|-------------------------------|--------------|--------------|
|                | 交易性金融资产                       |              | 合计           |
|                | 债券投资                          | 股票投资         |              |
| 期初余额           | -                             | 1,169,207.22 | 1,169,207.22 |
| 当期购买           | -                             | -            | -            |
| 当期出售/结算        | -                             | -            | -            |
| 转入第三层次         | -                             | 3,531,441.23 | 3,531,441.23 |
| 转出第三层次         | -                             | 3,157,383.48 | 3,157,383.48 |
| 当期利得或损失总额      | -                             | -235,206.66  | -235,206.66  |
| 其中：计入损益的利得或损失  | -                             | -235,206.66  | -235,206.66  |
| 计入其他综合收益的利得或损失 | -                             | -            | -            |
| 期末余额           | -                             | 1,308,058.31 | 1,308,058.31 |

|                                            |                                    |              |              |
|--------------------------------------------|------------------------------------|--------------|--------------|
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                  | -294,168.95  | -294,168.95  |
| 项目                                         | 上年度可比期间<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |              |              |
|                                            | 交易性金融资产                            |              | 合计           |
|                                            | 债券投资                               | 股票投资         |              |
| 期初余额                                       | -                                  | 5,616,226.70 | 5,616,226.70 |
| 当期购买                                       | -                                  | -            | -            |
| 当期出售/结算                                    | -                                  | -            | -            |
| 转入第三层次                                     | -                                  | 3,819,123.97 | 3,819,123.97 |
| 转出第三层次                                     | -                                  | 8,774,886.28 | 8,774,886.28 |
| 当期利得或损失总额                                  | -                                  | 508,742.83   | 508,742.83   |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -                                  | 508,742.83   | 508,742.83   |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -                                  | -            | -            |
| 期末余额                                       | -                                  | 1,169,207.22 | 1,169,207.22 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -                                  | -294,681.33  | -294,681.33  |

注：于2023年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允 | 采用的估值技 | 不可观察输入值 |
|----|-------|--------|---------|
|----|-------|--------|---------|

|          | 价值           | 术              | 名称          | 范围/加权<br>平均值      | 与公允价值之<br>间的关系 |
|----------|--------------|----------------|-------------|-------------------|----------------|
| 股票<br>投资 | 1,308,058.31 | 平均价格亚式<br>期权模型 | 预期年化<br>波动率 | 0.1962~2.19<br>88 | 负相关            |
| 项目       | 上年度末公<br>允价值 | 采用的估值技<br>术    | 不可观察输入值     |                   |                |
|          |              |                | 名称          | 范围/加权<br>平均值      | 与公允价值之<br>间的关系 |
| 股票<br>投资 | 1,169,207.22 | 平均价格亚式<br>期权模型 | 预期年化<br>波动率 | 0.1891~2.47<br>56 | 负相关            |

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31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)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

#### 7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额               | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 228,006,087.36   | 4.10         |
|    | 其中：股票  | 228,006,087.36   | 4.10         |
| 2  | 基金投资   | 5,015,594,347.86 | 90.12        |
| 3  | 固定收益投资 | 110,003.38       | 0.00         |
|    | 其中：债券  | 110,003.38       | 0.00         |
|    | 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      | 308,677,278.03   | 5.55   |
| 8 | 其他各项资产            | 13,026,873.12    | 0.23   |
| 9 | 合计                | 5,565,414,589.75 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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              | 226,559,258.05 | 4.09         |
| 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           | 1,335,029.59   | 0.02         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 13,981.41      | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 59,263.03      | 0.00         |
| J  | 金融业              | -              | -            |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,058.00       | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 26,564.46      | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 8,932.82       | 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          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |

|  |    |                |      |
|--|----|----------------|------|
|  | 合计 | 228,006,087.36 | 4.12 |
|--|----|----------------|------|

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 贵州茅台 | 14,683  | 25,342,858.00 | 0.46         |
| 2  | 600887 | 伊利股份 | 865,280 | 23,146,240.00 | 0.42         |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 158,935 | 22,300,169.85 | 0.40         |
| 4  | 000568 | 泸州老窖 | 106,498 | 19,107,871.16 | 0.35         |
| 5  | 600809 | 山西汾酒 | 70,612  | 16,292,306.76 | 0.29         |
| 6  | 002304 | 洋河股份 | 87,052  | 9,567,014.80  | 0.17         |
| 7  | 603288 | 海天味业 | 241,356 | 9,159,460.20  | 0.17         |
| 8  | 000596 | 古井贡酒 | 23,483  | 5,466,842.40  | 0.10         |
| 9  | 603369 | 今世缘  | 90,651  | 4,419,236.25  | 0.08         |
| 10 | 000895 | 双汇发展 | 150,357 | 4,016,035.47  | 0.07         |
| 11 | 600600 | 青岛啤酒 | 51,164  | 3,824,509.00  | 0.07         |
| 12 | 600702 | 舍得酒业 | 33,700  | 3,258,790.00  | 0.06         |
| 13 | 603345 | 安井食品 | 29,668  | 3,103,569.48  | 0.06         |
| 14 | 600298 | 安琪酵母 | 87,965  | 3,094,608.70  | 0.06         |
| 15 | 300999 | 金龙鱼  | 86,184  | 2,876,821.92  | 0.05         |
| 16 | 600872 | 中炬高新 | 90,913  | 2,554,655.30  | 0.05         |
| 17 | 300146 | 汤臣倍健 | 147,511 | 2,512,112.33  | 0.05         |
| 18 | 000799 | 酒鬼酒  | 32,863  | 2,403,928.45  | 0.04         |
| 19 | 600559 | 老白干酒 | 105,844 | 2,386,782.20  | 0.04         |
| 20 | 603589 | 口子窖  | 52,006  | 2,355,871.80  | 0.04         |
| 21 | 600132 | 重庆啤酒 | 34,952  | 2,322,560.40  | 0.04         |
| 22 | 603198 | 迎驾贡酒 | 34,683  | 2,299,136.07  | 0.04         |
| 23 | 605499 | 东鹏饮料 | 11,400  | 2,080,614.00  | 0.04         |
| 24 | 002568 | 百润股份 | 75,899  | 1,867,874.39  | 0.03         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 25 | 300765 | 新诺威  | 50,559  | 1,851,470.58 | 0.03 |
| 26 | 000729 | 燕京啤酒 | 203,925 | 1,759,872.75 | 0.03 |
| 27 | 002507 | 涪陵榨菜 | 116,743 | 1,668,257.47 | 0.03 |
| 28 | 600779 | 水井坊  | 28,198  | 1,657,196.46 | 0.03 |
| 29 | 000860 | 顺鑫农业 | 75,117  | 1,599,240.93 | 0.03 |
| 30 | 600186 | 莲花健康 | 259,400 | 1,569,370.00 | 0.03 |
| 31 | 603156 | 养元饮品 | 73,137  | 1,554,892.62 | 0.03 |
| 32 | 002557 | 洽洽食品 | 43,997  | 1,531,975.54 | 0.03 |
| 33 | 603517 | 绝味食品 | 54,769  | 1,471,095.34 | 0.03 |
| 34 | 600199 | 金种子酒 | 76,128  | 1,409,890.56 | 0.03 |
| 35 | 600737 | 中粮糖业 | 154,700 | 1,274,728.00 | 0.02 |
| 36 | 603027 | 千禾味业 | 74,354  | 1,202,304.18 | 0.02 |
| 37 | 002597 | 金禾实业 | 49,300  | 1,080,163.00 | 0.02 |
| 38 | 002840 | 华统股份 | 44,287  | 920,726.73   | 0.02 |
| 39 | 603919 | 金徽酒  | 36,506  | 898,777.72   | 0.02 |
| 40 | 600197 | 伊力特  | 40,803  | 887,465.25   | 0.02 |
| 41 | 603866 | 桃李面包 | 115,660 | 885,955.60   | 0.02 |
| 42 | 002726 | 龙大美食 | 109,169 | 884,268.90   | 0.02 |
| 43 | 600597 | 光明乳业 | 99,661  | 870,040.53   | 0.02 |
| 44 | 600059 | 古越龙山 | 92,291  | 858,306.30   | 0.02 |
| 45 | 002216 | 三全食品 | 63,522  | 851,194.80   | 0.02 |
| 46 | 002847 | 盐津铺子 | 11,300  | 785,124.00   | 0.01 |
| 47 | 600084 | 中信尼雅 | 97,400  | 765,564.00   | 0.01 |
| 48 | 600305 | 恒顺醋业 | 80,442  | 740,870.82   | 0.01 |
| 49 | 002626 | 金达威  | 44,100  | 720,153.00   | 0.01 |
| 50 | 000848 | 承德露露 | 91,350  | 717,097.50   | 0.01 |
| 51 | 000523 | 红棉股份 | 213,500 | 670,390.00   | 0.01 |
| 52 | 600238 | 海南椰岛 | 64,700  | 657,999.00   | 0.01 |
| 53 | 600189 | 泉阳泉  | 61,980  | 648,310.80   | 0.01 |
| 54 | 600073 | 上海梅林 | 94,964  | 646,704.84   | 0.01 |
| 55 | 603043 | 广州酒家 | 32,833  | 641,228.49   | 0.01 |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 56 | 002570 | 贝因美  | 156,139 | 616,749.05 | 0.01 |
| 57 | 603317 | 天味食品 | 46,250  | 614,662.50 | 0.01 |
| 58 | 600882 | 妙可蓝多 | 37,101  | 596,213.07 | 0.01 |
| 59 | 002515 | 金字火腿 | 105,400 | 594,456.00 | 0.01 |
| 60 | 002329 | 皇氏集团 | 87,900  | 569,592.00 | 0.01 |
| 61 | 002646 | 天佑德酒 | 40,957  | 557,424.77 | 0.01 |
| 62 | 300783 | 三只松鼠 | 28,900  | 521,645.00 | 0.01 |
| 63 | 600300 | 维维股份 | 163,700 | 509,107.00 | 0.01 |
| 64 | 002461 | 珠江啤酒 | 64,050  | 505,995.00 | 0.01 |
| 65 | 603719 | 良品铺子 | 23,100  | 498,036.00 | 0.01 |
| 66 | 000869 | 张裕A  | 19,921  | 480,892.94 | 0.01 |
| 67 | 003000 | 劲仔食品 | 39,100  | 477,802.00 | 0.01 |
| 68 | 002481 | 双塔食品 | 107,100 | 472,311.00 | 0.01 |
| 69 | 300973 | 立高食品 | 9,660   | 468,993.00 | 0.01 |
| 70 | 000716 | 黑芝麻  | 75,500  | 454,510.00 | 0.01 |
| 71 | 300791 | 仙乐健康 | 12,900  | 447,114.00 | 0.01 |
| 72 | 605077 | 华康股份 | 19,767  | 427,757.88 | 0.01 |
| 73 | 000639 | 西王食品 | 93,484  | 413,199.28 | 0.01 |
| 74 | 002650 | 加加食品 | 99,900  | 407,592.00 | 0.01 |
| 75 | 605016 | 百龙创园 | 14,300  | 405,977.00 | 0.01 |
| 76 | 001215 | 千味央厨 | 7,500   | 396,075.00 | 0.01 |
| 77 | 603170 | 宝立食品 | 22,900  | 387,239.00 | 0.01 |
| 78 | 300741 | 华宝股份 | 17,717  | 379,320.97 | 0.01 |
| 79 | 600419 | 天润乳业 | 32,300  | 378,879.00 | 0.01 |
| 80 | 002991 | 甘源食品 | 5,300   | 378,738.00 | 0.01 |
| 81 | 601579 | 会稽山  | 34,600  | 371,604.00 | 0.01 |
| 82 | 300858 | 科拓生物 | 18,800  | 362,840.00 | 0.01 |
| 83 | 002695 | 煌上煌  | 32,123  | 336,327.81 | 0.01 |
| 84 | 301206 | 三元生物 | 11,600  | 335,008.00 | 0.01 |
| 85 | 000505 | 京粮控股 | 47,800  | 326,952.00 | 0.01 |
| 86 | 605337 | 李子园  | 22,774  | 320,885.66 | 0.01 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 87  | 605388 | 均瑶健康 | 24,800 | 310,992.00 | 0.01 |
| 88  | 605338 | 巴比食品 | 14,300 | 307,164.00 | 0.01 |
| 89  | 600965 | 福成股份 | 47,000 | 296,570.00 | 0.01 |
| 90  | 600429 | 三元股份 | 65,800 | 293,468.00 | 0.01 |
| 91  | 002946 | 新乳业  | 24,905 | 285,909.40 | 0.01 |
| 92  | 001338 | 永顺泰  | 21,700 | 261,702.00 | 0.00 |
| 93  | 603777 | 来伊份  | 19,300 | 259,006.00 | 0.00 |
| 94  | 603057 | 紫燕食品 | 11,900 | 256,802.00 | 0.00 |
| 95  | 605089 | 味知香  | 5,948  | 217,339.92 | 0.00 |
| 96  | 603711 | 香飘飘  | 11,800 | 202,252.00 | 0.00 |
| 97  | 300997 | 欢乐家  | 12,928 | 180,604.16 | 0.00 |
| 98  | 605179 | 一鸣食品 | 11,300 | 167,240.00 | 0.00 |
| 99  | 605300 | 佳禾食品 | 8,600  | 134,676.00 | 0.00 |
| 100 | 688563 | 航材股份 | 1,501  | 90,795.49  | 0.00 |
| 101 | 605198 | 安德利  | 3,000  | 69,900.00  | 0.00 |
| 102 | 688548 | 广钢气体 | 4,048  | 51,612.00  | 0.00 |
| 103 | 603296 | 华勤技术 | 593    | 46,105.75  | 0.00 |
| 104 | 301526 | C国际复 | 9,723  | 43,267.35  | 0.00 |
| 105 | 301487 | 盟固利  | 867    | 35,512.32  | 0.00 |
| 106 | 688549 | 中巨芯  | 4,294  | 34,738.46  | 0.00 |
| 107 | 301348 | 蓝箭电子 | 613    | 27,321.41  | 0.00 |
| 108 | 688702 | 盛科通信 | 549    | 26,450.82  | 0.00 |
| 109 | 688582 | 芯动联科 | 648    | 25,058.16  | 0.00 |
| 110 | 301559 | 中集环科 | 1,315  | 23,985.60  | 0.00 |
| 111 | 301486 | 致尚科技 | 482    | 22,774.50  | 0.00 |
| 112 | 688652 | 京仪装备 | 416    | 21,736.00  | 0.00 |
| 113 | 301525 | 儒竞科技 | 266    | 21,668.36  | 0.00 |
| 114 | 301498 | 乖宝宠物 | 554    | 21,500.74  | 0.00 |
| 115 | 301371 | 敷尔佳  | 564    | 21,195.12  | 0.00 |
| 116 | 301370 | 国科恒泰 | 1,240  | 19,852.40  | 0.00 |
| 117 | 301421 | 波长光电 | 332    | 19,710.84  | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 118 | 301558 | 三态股份 | 1,458 | 19,537.20 | 0.00 |
| 119 | 688627 | 精智达  | 222   | 19,473.84 | 0.00 |
| 120 | 688591 | 泰凌微  | 681   | 19,081.62 | 0.00 |
| 121 | 300904 | 威力传动 | 304   | 18,705.12 | 0.00 |
| 122 | 301488 | 豪恩汽电 | 262   | 18,101.58 | 0.00 |
| 123 | 301381 | 赛维时代 | 571   | 16,952.99 | 0.00 |
| 124 | 301172 | 君逸数码 | 438   | 16,714.08 | 0.00 |
| 125 | 301509 | 金凯生科 | 266   | 16,553.18 | 0.00 |
| 126 | 688612 | 威迈斯  | 422   | 16,023.34 | 0.00 |
| 127 | 601096 | 宏盛华源 | 3,918 | 15,907.08 | 0.00 |
| 128 | 301393 | 昊帆生物 | 260   | 15,436.20 | 0.00 |
| 129 | 601083 | 锦江航运 | 1,263 | 13,981.41 | 0.00 |
| 130 | 301510 | 固高科技 | 396   | 13,863.96 | 0.00 |
| 131 | 301507 | 民生健康 | 851   | 13,488.35 | 0.00 |
| 132 | 301210 | 金杨股份 | 281   | 12,779.88 | 0.00 |
| 133 | 301566 | N达利  | 576   | 12,752.64 | 0.00 |
| 134 | 301456 | 盘古智能 | 407   | 12,368.73 | 0.00 |
| 135 | 688602 | 康鹏科技 | 1,066 | 11,789.96 | 0.00 |
| 136 | 688719 | 爱科赛博 | 194   | 11,659.40 | 0.00 |
| 137 | 301550 | 斯菱股份 | 260   | 11,328.20 | 0.00 |
| 138 | 301292 | 海科新源 | 583   | 11,281.05 | 0.00 |
| 139 | 301508 | 中机认检 | 419   | 11,178.92 | 0.00 |
| 140 | 301251 | 威尔高  | 321   | 11,103.39 | 0.00 |
| 141 | 688592 | 司南导航 | 216   | 10,914.48 | 0.00 |
| 142 | 301499 | 维科精密 | 371   | 10,733.03 | 0.00 |
| 143 | 688603 | 天承科技 | 140   | 10,379.60 | 0.00 |
| 144 | 688653 | 康希通信 | 648   | 10,361.52 | 0.00 |
| 145 | 301528 | 多浦乐  | 148   | 10,198.68 | 0.00 |
| 146 | 301329 | 信音电子 | 458   | 10,181.34 | 0.00 |
| 147 | 301261 | 恒工精密 | 198   | 10,068.30 | 0.00 |
| 148 | 301202 | 朗威股份 | 306   | 9,730.80  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 149 | 301395 | 仁信新材 | 520 | 9,718.80 | 0.00 |
| 150 | 688716 | 中研股份 | 267 | 9,716.13 | 0.00 |
| 151 | 301413 | 安培龙  | 164 | 9,543.16 | 0.00 |
| 152 | 301500 | 飞南资源 | 455 | 9,504.95 | 0.00 |
| 153 | 301418 | 协昌科技 | 189 | 9,487.80 | 0.00 |
| 154 | 301516 | 中远通  | 604 | 9,368.04 | 0.00 |
| 155 | 301272 | 英华特  | 173 | 9,234.74 | 0.00 |
| 156 | 301469 | 恒达新材 | 275 | 9,099.75 | 0.00 |
| 157 | 301519 | 舜禹股份 | 442 | 8,932.82 | 0.00 |
| 158 | 301518 | 长华化学 | 385 | 8,858.85 | 0.00 |
| 159 | 301568 | 思泰克  | 246 | 8,752.68 | 0.00 |
| 160 | 301520 | 万邦医药 | 160 | 8,438.40 | 0.00 |
| 161 | 301459 | 丰茂股份 | 208 | 8,286.72 | 0.00 |
| 162 | 688720 | 艾森股份 | 165 | 8,223.60 | 0.00 |
| 163 | 688573 | 信宇人  | 285 | 8,208.00 | 0.00 |
| 164 | 301489 | 思泉新材 | 128 | 8,206.08 | 0.00 |
| 165 | 688651 | 盛邦安全 | 178 | 8,196.90 | 0.00 |
| 166 | 301517 | 陕西华达 | 185 | 8,082.65 | 0.00 |
| 167 | 301578 | C辰奕  | 118 | 8,061.76 | 0.00 |
| 168 | 301548 | 崇德科技 | 136 | 8,022.64 | 0.00 |
| 169 | 688657 | 浩辰软件 | 101 | 7,901.23 | 0.00 |
| 170 | 688646 | 逸飞激光 | 219 | 7,899.33 | 0.00 |
| 171 | 688671 | 碧兴物联 | 226 | 7,751.80 | 0.00 |
| 172 | 688693 | 锆威特  | 178 | 7,726.98 | 0.00 |
| 173 | 603275 | 众辰科技 | 193 | 7,662.10 | 0.00 |
| 174 | 301533 | 威马农机 | 225 | 7,461.00 | 0.00 |
| 175 | 603062 | 麦加芯彩 | 126 | 7,284.06 | 0.00 |
| 176 | 301555 | 惠柏新材 | 224 | 7,266.56 | 0.00 |
| 177 | 301505 | 苏州规划 | 194 | 6,947.14 | 0.00 |
| 178 | 301529 | 福赛科技 | 182 | 6,894.16 | 0.00 |
| 179 | 301515 | 港通医疗 | 230 | 6,502.10 | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 180 | 688648 | 中邮科技 | 303 | 6,493.29 | 0.00 |
| 181 | 688450 | 光格科技 | 167 | 6,082.14 | 0.00 |
| 182 | 603004 | C鼎龙  | 195 | 6,082.05 | 0.00 |
| 183 | 603270 | 金帝股份 | 195 | 5,768.10 | 0.00 |
| 184 | 603119 | 浙江荣泰 | 226 | 5,394.62 | 0.00 |
| 185 | 603107 | 上海汽配 | 292 | 5,311.48 | 0.00 |
| 186 | 603193 | 润本股份 | 303 | 5,047.98 | 0.00 |
| 187 | 001306 | 夏厦精密 | 64  | 4,823.04 | 0.00 |
| 188 | 001326 | 联域股份 | 99  | 4,815.36 | 0.00 |
| 189 | 603075 | 热威股份 | 182 | 4,242.42 | 0.00 |
| 190 | 001358 | 兴欣新材 | 87  | 3,841.92 | 0.00 |
| 191 | 001239 | 永达股份 | 189 | 3,764.88 | 0.00 |
| 192 | 603231 | 索宝蛋白 | 161 | 3,466.33 | 0.00 |
| 193 | 603273 | 天元智能 | 178 | 3,376.66 | 0.00 |
| 194 | 603276 | 恒兴新材 | 134 | 3,333.92 | 0.00 |
| 195 | 603373 | 安邦护卫 | 88  | 3,058.00 | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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  | 000858 | 五粮液  | 78,132,713.52 | 1.07           |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 66,521,097.95 | 0.91           |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 63,941,595.00 | 0.88           |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 62,606,330.81 | 0.86           |
| 5  | 600809 | 山西汾酒 | 41,580,591.68 | 0.57           |
| 6  | 002304 | 洋河股份 | 34,595,466.98 | 0.48           |
| 7  | 603288 | 海天味业 | 32,555,311.45 | 0.45           |
| 8  | 000596 | 古井贡酒 | 16,592,289.30 | 0.23           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 9  | 600702 | 舍得酒业 | 15,660,390.84 | 0.22 |
| 10 | 603369 | 今世缘  | 12,279,607.00 | 0.17 |
| 11 | 600600 | 青岛啤酒 | 12,190,554.52 | 0.17 |
| 12 | 000895 | 双汇发展 | 11,246,960.28 | 0.15 |
| 13 | 000799 | 酒鬼酒  | 11,020,419.00 | 0.15 |
| 14 | 603345 | 安井食品 | 9,801,621.00  | 0.13 |
| 15 | 300999 | 金龙鱼  | 9,619,150.21  | 0.13 |
| 16 | 300146 | 汤臣倍健 | 9,160,677.00  | 0.13 |
| 17 | 600132 | 重庆啤酒 | 9,060,977.00  | 0.12 |
| 18 | 002568 | 百润股份 | 7,909,892.39  | 0.11 |
| 19 | 600872 | 中炬高新 | 7,805,141.00  | 0.11 |
| 20 | 600559 | 老白干酒 | 7,683,965.00  | 0.11 |

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。

#### 8.4.2 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  | 000858 | 五粮液  | 158,673,362.45 | 2.18           |
| 2  | 000568 | 泸州老窖 | 125,339,829.20 | 1.72           |
| 3  | 002304 | 洋河股份 | 69,659,539.08  | 0.96           |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 53,628,187.00  | 0.74           |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 49,373,489.99  | 0.68           |
| 6  | 600809 | 山西汾酒 | 34,641,193.80  | 0.48           |
| 7  | 000596 | 古井贡酒 | 29,572,000.00  | 0.41           |
| 8  | 000799 | 酒鬼酒  | 26,525,453.33  | 0.36           |
| 9  | 603288 | 海天味业 | 25,638,196.93  | 0.35           |
| 10 | 000895 | 双汇发展 | 20,394,627.74  | 0.28           |
| 11 | 300999 | 金龙鱼  | 18,066,971.91  | 0.25           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 300146 | 汤臣倍健 | 16,175,412.13 | 0.22 |
| 13 | 002568 | 百润股份 | 15,704,385.60 | 0.22 |
| 14 | 000729 | 燕京啤酒 | 12,506,344.73 | 0.17 |
| 15 | 000860 | 顺鑫农业 | 12,077,694.00 | 0.17 |
| 16 | 002507 | 涪陵榨菜 | 10,729,475.20 | 0.15 |
| 17 | 600702 | 舍得酒业 | 9,951,123.00  | 0.14 |
| 18 | 603369 | 今世缘  | 9,816,509.49  | 0.13 |
| 19 | 600600 | 青岛啤酒 | 9,692,006.00  | 0.13 |
| 20 | 002557 | 洽洽食品 | 9,177,150.00  | 0.13 |

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 725,756,290.53 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 946,446,453.43 |

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -          | -            |
| 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) | 110,003.38 | 0.00         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |

|    |    |            |      |
|----|----|------------|------|
| 10 | 合计 | 110,003.38 | 0.00 |
|----|----|------------|------|

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 111018 | 华康转债 | 1,100 | 110,003.38 | 0.00         |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称                   | 类型  | 运作方式   | 管理人        | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------------|-----|--------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金 | 股票型 | 交易型开放式 | 天弘基金管理有限公司 | 5,015,594,347.86 | 90.62        |

### 8.11 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。

**8.12 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。

**8.13 投资组合报告附注**

**8.13.1** 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。

**8.13.2** 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。

**8.13.3 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 | 567,135.83    |
| 2  | 应收清算款 | 154,475.23    |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 12,305,262.06 |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 13,026,873.12 |

**8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.13.6 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。

**§9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 份额级别            | 持有人户数(户)  | 户均持有的基金份额 | 持有人结构        |        |                  |        |
|-----------------|-----------|-----------|--------------|--------|------------------|--------|
|                 |           |           | 机构投资者        |        | 个人投资者            |        |
|                 |           |           | 持有份额         | 占总份额比例 | 持有份额             | 占总份额比例 |
| 天弘中证食品饮料E TF联接A | 31,410.00 | 1,556.54  | 45,120.09    | 0.01%  | 488,864,263.56   | 99.99% |
| 天弘中证食品饮料E TF联接C | 1,867,280 | 1,012.18  | 6,420,460.30 | 0.34%  | 1,883,597,362.76 | 99.66% |
| 合计              | 2,153,172 | 1,104.85  | 6,465,580.39 | 0.27%  | 2,372,461,626.32 | 99.73% |

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别            | 持有份额总数(份)  | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 天弘中证食品饮料E TF联接A | 282,166.82 | 0.06%    |
|                  | 天弘中证食品饮料E TF联接C | 254,882.20 | 0.01%    |
|                  | 合计              | 537,049.02 | 0.02%    |

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

| 项目                             | 份额级别           | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 天弘中证食品饮料ETF联接A | 0~10              |
|                                | 天弘中证食品饮料ETF联接C | 0~10              |
|                                | 合计             | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 天弘中证食品饮料ETF联接A | 0~10              |
|                                | 天弘中证食品饮料ETF联接C | 0                 |
|                                | 合计             | 0~10              |

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                            | 天弘中证食品饮料ETF联接A | 天弘中证食品饮料ETF联接C   |
|----------------------------|----------------|------------------|
| 基金合同生效日(2015年07月29日)基金份额总额 | 5,000,000.00   | 5,000,000.00     |
| 本报告期期初基金份额总额               | 577,761,452.82 | 1,983,338,286.04 |
| 本报告期基金总申购份额                | 154,399,441.06 | 1,446,059,114.91 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 243,251,510.23 | 1,539,379,577.89 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 488,909,383.65 | 1,890,017,823.06 |

**§11 重大事件揭示****11.1 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。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

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》。

本报告期内，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，高阳先生担任公司总经理，韩歆毅先生不再代任公司总经理，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》。

本基金托管人的专门基金托管部门有如下重大人事变动：自2023年12月28日起，孙沛涛先生任托管部行政负责人，吴俊文女士不再担任托管部行政负责人。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费120,000.00元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务8年6个月。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本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。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商 | 交 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备 |
|----|---|------|-----------|---|
|    |   |      |           |   |

| 名称     | 易单元数量 | 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 | 注 |
|--------|-------|----------------|--------------|------------|------------|---|
| 东方财富证券 | 2     | -              | -            | -          | -          | - |
| 方正证券   | 1     | -              | -            | -          | -          | - |
| 国联证券   | 2     | 98,280,440.29  | 5.98%        | 42,480.85  | 6.48%      | - |
| 民生证券   | 1     | -              | -            | -          | -          | - |
| 天风证券   | 1     | 308,616,521.99 | 18.78%       | 133,108.64 | 20.31%     | - |
| 银河证券   | 1     | 957,996,173.06 | 58.29%       | 414,318.37 | 63.22%     | - |
| 中信证券   | 7     | 278,558,716.70 | 16.95%       | 65,453.29  | 9.99%      | - |

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：民生证券北交所交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | 债券回购交易 | 权证交易 | 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 | -            | -            | -    | -              | -    | -            | -              | -            |
| 方正证券   | -            | -            | -    | -              | -    | -            | -              | -            |
| 国联证券   | 110,000.00   | 1.46%        | -    | -              | -    | -            | -              | -            |
| 民生证券   | -            | -            | -    | -              | -    | -            | -              | -            |
| 天风证券   | 7,094,178.00 | 94.45%       | -    | -              | -    | -            | -              | -            |
| 银河证券   | 131,765.50   | 1.75%        | -    | -              | -    | -            | 209,647,766.70 | 100.00%      |
| 中信证券   | 174,749.31   | 2.33%        | -    | -              | -    | -            | -              | -            |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                  | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|---------------------------------------|-----------|------------|
| 1  | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-19 |
| 2  | 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2022年第4季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-28 |
| 3  | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-30 |
| 4  | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-03 |
| 5  | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-13 |
| 6  | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-23 |
| 7  | 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 |
| 8  | 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2022年年度报告   | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-31 |
| 9  | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-01 |
| 10 | 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 |
| 11 | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-03 |
| 12 | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-13 |

|    |                                              |           |            |
|----|----------------------------------------------|-----------|------------|
| 13 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-15 |
| 14 | 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2023年第1季度报告        | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-23 |
| 15 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-27 |
| 16 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-15 |
| 17 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-29 |
| 18 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-31 |
| 19 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-19 |
| 20 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-21 |
| 21 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-07-01 |
| 22 | 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（A类份额）基金产品资料概要（更新） | 中国证监会规定媒介 | 2023-07-05 |
| 23 | 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（C类份额）基金产品资料概要（更新） | 中国证监会规定媒介 | 2023-07-05 |
| 24 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-07-14 |
| 25 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-07-19 |
| 26 | 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2023年第2季度报告        | 中国证监会规定媒介 | 2023-07-21 |
| 27 | 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 | 2023-07-24 |
| 28 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-07-26 |
| 29 | 天弘基金管理有限公司公告                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-08-03 |
| 30 | 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2023年中期报告          | 中国证监会规定媒介 | 2023-08-31 |
| 31 | 天弘基金管理有限公司关于                                 | 中国证监会规定媒介 | 2023-09-01 |

|    |                                       |           |            |
|----|---------------------------------------|-----------|------------|
|    | 终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告     |           |            |
| 32 | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-09-23 |
| 33 | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-09-28 |
| 34 | 天弘基金管理有限公司公告                          | 中国证监会规定媒介 | 2023-10-11 |
| 35 | 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招募说明书（更新）   | 中国证监会规定媒介 | 2023-10-21 |
| 36 | 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2023年第3季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-10-25 |
| 37 | 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 | 2023-12-30 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

### 12.2 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证食品饮料指数型发起式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联接基金基金合同
- 3、天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
- 4、天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书
- 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

### 13.2 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

### 13.3 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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二四年三月二十九日