

# 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金

## 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 7  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| §4 管理人报告                                | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12 |
| §5 托管人报告                                | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 13 |
| 6.1 资产负债表                               | 13 |
| 6.2 利润表                                 | 15 |
| 6.3 净资产变动表                              | 16 |
| 6.4 报表附注                                | 18 |
| §7 投资组合报告                               | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 44 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 45 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 47 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 51 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 53 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 53 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 54 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 54 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细      | 54 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 54 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 54 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 54 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 55 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 55 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 56 |

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 56 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 56 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 56 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 56 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....  | 56 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 56 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 57 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 57 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....      | 57 |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....  | 57 |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 59 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 61 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 61 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....               | 62 |
| §12 备查文件目录.....                         | 62 |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 62 |
| 12.2 存放地点.....                          | 62 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 62 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

|              |                        |
|--------------|------------------------|
| 基金名称         | 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 天弘中证食品饮料ETF            |
| 场内简称         | 食品饮料ETF天弘              |
| 基金主代码        | 159736                 |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                 |
| 基金合同生效日      | 2021年09月09日            |
| 基金管理人        | 天弘基金管理有限公司             |
| 基金托管人        | 中信证券股份有限公司             |
| 报告期末基金份额总额   | 7,414,394,457.00份      |
| 基金合同存续期      | 不定期                    |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                |
| 上市日期         | 2021年09月27日            |

2.2 基金产品说明

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

|        |                                                                                               |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 股相关的衍生工具。主要产品投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等策略。                  |
| 业绩比较基准 | 中证食品饮料指数收益率                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                                        | 基金托管人                       |
|---------|------|----------------------------------------------|-----------------------------|
| 名称      |      | 天弘基金管理有限公司                                   | 中信证券股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 童建林                                          | 杨军智                         |
|         | 联系电话 | 022-83310208                                 | 010-60834299                |
|         | 电子邮箱 | service@thfund.com.cn                        | yjz@citics.com              |
| 客户服务电话  |      | 400-986-8888                                 | 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（新金融大厦）16层02单元3号房间 | 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   |      | 黄辰立                                          | 张佑君                         |

2.4 信息披露方式

|                |                   |
|----------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报              |
| 登载基金中期报告的      | www.thfund.com.cn |

|            |                  |
|------------|------------------|
| 管理人互联网网址   |                  |
| 基金中期报告置备地点 | 基金管理人及基金托管人的办公地址 |

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期<br>(2026年01月01日- 2026年06月30日) |
|---------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益       | -183,625,588.03                   |
| 本期利润          | -1,042,115,737.98                 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1333                           |
| 本期加权平均净值利润率   | -20.64%                           |
| 本期基金份额净值增长率   | -19.72%                           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2026年06月30日)             |
| 期末可供分配利润      | -3,330,928,303.37                 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.4493                           |
| 期末基金资产净值      | 4,083,466,153.63                  |
| 期末基金份额净值      | 0.5507                            |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2026年06月30日)             |
| 基金份额累计净值增长率   | -44.93%                           |

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

- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

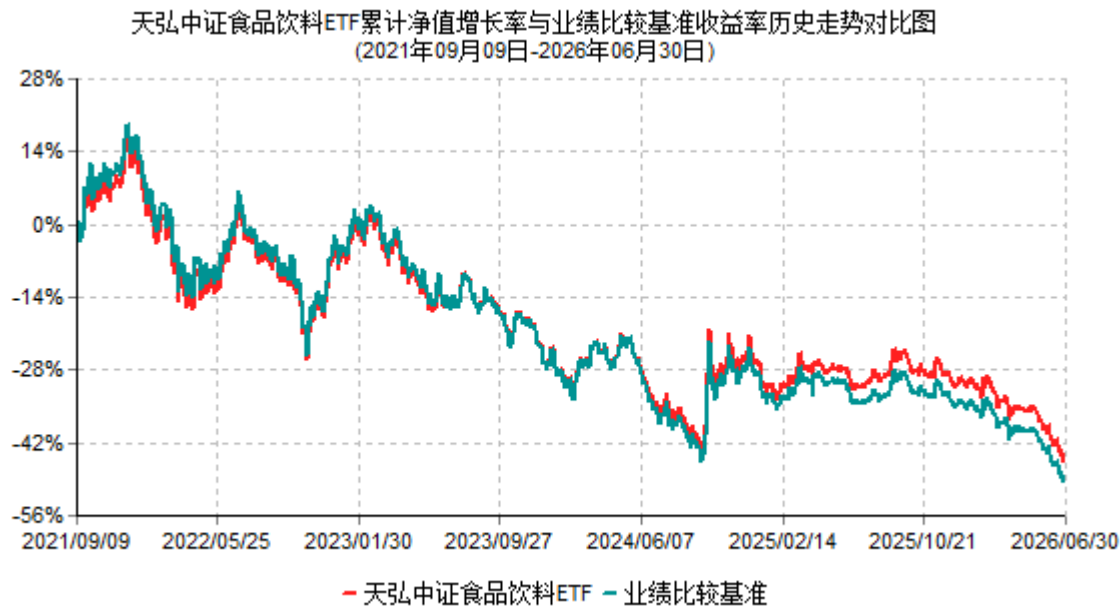
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段                  | 份额净值<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               | -14.61%      | 1.01%               | -15.93%            | 1.02%                     | 1.32% | -0.01% |
| 过去六个月               | -19.72%      | 1.18%               | -21.00%            | 1.19%                     | 1.28% | -0.01% |
| 过去一年                | -20.36%      | 1.04%               | -22.79%            | 1.04%                     | 2.43% | 0.00%  |
| 过去三年                | -34.41%      | 1.38%               | -39.40%            | 1.38%                     | 4.99% | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效日起至<br>今 | -44.93%      | 1.45%               | -49.12%            | 1.47%                     | 4.19% | -0.02% |

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





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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2026年06月30日，公司共管理运作267只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务      | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                 |
|----|---------|-----------------|------|--------|----------------------------------------------------|
|    |         | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                    |
| 沙川 | 本基金基金经理 | 2021年09月09日     | -    | 15年    | 男，数学硕士。历任中国中投证券有限责任公司金融工程助理分析师。2013年9月加盟本公司，历任研究员。 |

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。  
2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规有关规定及基金合同相关约定进行操作，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的有关规定以及基金合同的相关约定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。  
本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，未发生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2026年上半年按照基金合同约定采用完全复制的投资策略来控制跟踪误差，并力争在跟踪误差允许范围内获取更多收益。

期间基金整体运行平稳，日均跟踪偏离和年化跟踪误差均控制在合理范围内。日均跟踪偏离和跟踪误差主要来自基金每日的申购赎回导致的基金仓位和结构变化，指数成分股分红，指数成分股调整，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2026年06月30日，本基金份额净值为0.5507元，本报告期份额净值增长率-19.72%，同期业绩比较基准增长率-21.00%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年，国内GDP增长4.7%，在一季度超预期开局的情况下，二季度有所回落。从结构看，全球AI投资热潮，带动了出口和生产端的增长；但投资端，基建投资放缓，制造业产能过剩，房地产尚无起色；内需方面，由于出口利润主要集中在高新技术产品，且地缘扰动导致的原材料价格上涨并未有效向下游传导，劳动密集型行业利润受到挤压，压制了居民收入和消费，内需鲜有亮点。

展望下半年，单纯依靠出口支撑经济风险较高，财政政策会聚焦在内需的投资和消费方向。但由于经济增长目标变为区间，或意味着决策层容忍度提高，所以也不宜过高预期政策力度和范围，更多是托底性质。货币政策方面，下半年随着输入性因素缓和，货币政策大概率维持现状，宏观流动性保持宽松水平。

上半年股票市场也反映了宏观经济新旧动能转换的结构性特征，资金在弱复苏环境下对高景气度形成明显的倾向性。行业景气度成为市场交易主线，资金高度聚焦科技赛道，成长风格大幅占优，价值、红利及微盘板块表现相对偏弱。展望下半年，景气交易或仍是主线，但市场风格轮动可能更加频繁，困境反转和业绩确定性较高的价值投资都会有阶段性相对较好表现。而市场风险可能出现在业绩兑现期，以及美股科技板块大幅波动的时候，美国中期选举结果或是较大的不确定因素。

对于行业层面，扩大内需相关政策出台，龙头企业提价，以及市场风格转向困境反转逻辑，或阶段性支撑食品饮料板块的反弹行情，但企业利润的实质性修复以及板块的趋势性反转，还需依赖经济的全面好转以及居民收入的持续提升。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人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，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。

本基金托管人根据法律法规要求履行基金估值及净值计算的复核责任。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由天弘基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

| 资 产          | 附注号     | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|--------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资 产：         |         |                    |                     |
| 货币资金         | 6.4.7.1 | 10,056,442.70      | 5,163,718.42        |
| 结算备付金        |         | 1,102,441.09       | 1,289,276.67        |
| 存出保证金        |         | 810,166.41         | 1,296,991.26        |
| 交易性金融资产      | 6.4.7.2 | 4,074,770,464.62   | 5,415,936,308.31    |
| 其中：股票投资      |         | 4,074,770,464.62   | 5,415,936,308.31    |
| 基金投资         |         | -                  | -                   |
| 债券投资         |         | -                  | -                   |
| 资产支持证券<br>投资 |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资        |         | -                  | -                   |
| 其他投资         |         | -                  | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | 4,222,284.63               | 5,848,590.10                |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | 60,492.63                  | -                           |
| 资产总计          |            | 4,091,022,292.08           | 5,429,534,884.76            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2025年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>   |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | 5,163,414.99               | 5,617,243.79                |
| 应付赎回款         |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 1,783,622.93               | 2,338,595.62                |
| 应付托管费         |            | 356,724.60                 | 467,719.16                  |
| 应付销售服务费       |            | -                          | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | -                          | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 252,375.93                 | 315,780.24                  |
| 负债合计          |            | 7,556,138.45               | 8,739,338.81                |
| <b>净资产:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 7,414,394,457.00           | 7,902,394,457.00            |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | -3,330,928,303.37          | -2,481,598,911.05           |
| 净资产合计         |            | 4,083,466,153.63           | 5,420,795,545.95            |
| 负债和净资产总计      |            | 4,091,022,292.08           | 5,429,534,884.76            |

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值0.5507元，基金份额总额7,414,394,457.00份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号      | 本期<br>2026年01月01日至<br>2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至202<br>5年06月30日 |
|-----------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入               |          | -1,026,880,030.16                 | -223,053,933.72                        |
| 1.利息收入                |          | 52,088.25                         | 45,772.14                              |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 52,088.25                         | 45,772.14                              |
| 债券利息收入                |          | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产收入            |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入                |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | -169,342,825.86                   | -60,109,152.89                         |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | -244,674,796.40                   | -156,632,895.72                        |
| 基金投资收益                |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券投资              | 6.4.7.12 | -                                 | -                                      |
| 收益                    |          |                                   |                                        |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.13 | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.14 | -                                 | -                                      |
| 股利收益                  | 6.4.7.15 | 75,331,970.54                     | 96,523,742.83                          |
| 其他投资收益                |          | -                                 | -                                      |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -858,490,149.95                   | -163,188,360.47                        |

|                     |          |                   |                 |
|---------------------|----------|-------------------|-----------------|
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）   |          | -                 | -               |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）   | 6.4.7.17 | 900,857.40        | 197,807.50      |
| 减：二、营业总支出           |          | 15,235,707.82     | 14,511,026.37   |
| 1.管理人报酬             |          | 12,555,920.46     | 11,939,622.27   |
| 2.托管费               |          | 2,511,184.05      | 2,387,924.40    |
| 3.销售服务费             |          | -                 | -               |
| 4.投资顾问费             |          | -                 | -               |
| 5.利息支出              |          | -                 | -               |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | -                 | -               |
| 6.信用减值损失            | 6.4.7.18 | -                 | -               |
| 7.税金及附加             |          | -                 | -               |
| 8.其他费用              | 6.4.7.19 | 168,603.31        | 183,479.70      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | -1,042,115,737.98 | -237,564,960.09 |
| 减：所得税费用             |          | -                 | -               |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | -1,042,115,737.98 | -237,564,960.09 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -                 | -               |
| 六、综合收益总额            |          | -1,042,115,737.98 | -237,564,960.09 |

6.3 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

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目       | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                   |                  |
|-----------|-------------------------------|-------------------|------------------|
|           | 实收基金                          | 未分配利润             | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产 | 7,902,394,457.00              | -2,481,598,911.05 | 5,420,795,545.95 |



|                                          |                                    |                   |                   |
|------------------------------------------|------------------------------------|-------------------|-------------------|
| 产                                        |                                    |                   |                   |
| 二、本期期初净资产                                | 7,902,394,457.00                   | -2,481,598,911.05 | 5,420,795,545.95  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -488,000,000.00                    | -849,329,392.32   | -1,337,329,392.32 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | -1,042,115,737.98 | -1,042,115,737.98 |
| （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）      | -488,000,000.00                    | 192,786,345.66    | -295,213,654.34   |
| 其中：1.基金申购款                               | 416,000,000.00                     | -142,460,918.46   | 273,539,081.54    |
| 2.基金赎回款                                  | -904,000,000.00                    | 335,247,264.12    | -568,752,735.88   |
| （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                                | 7,414,394,457.00                   | -3,330,928,303.37 | 4,083,466,153.63  |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |                   |                   |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润             | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                                | 6,906,394,457.00                   | -1,882,094,709.42 | 5,024,299,747.58  |
| 二、本期期初净资产                                | 6,906,394,457.00                   | -1,882,094,709.42 | 5,024,299,747.58  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -120,000,000.00                    | -211,705,505.10   | -331,705,505.10   |

|                                          |                  |                   |                  |
|------------------------------------------|------------------|-------------------|------------------|
| （一）、综合收益总额                               | -                | -237,564,960.09   | -237,564,960.09  |
| （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）      | -120,000,000.00  | 25,859,454.99     | -94,140,545.01   |
| 其中：1.基金申购款                               | 334,000,000.00   | -101,154,803.41   | 232,845,196.59   |
| 2.基金赎回款                                  | -454,000,000.00  | 127,014,258.40    | -326,985,741.60  |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                | -                 | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 6,786,394,457.00 | -2,093,800,214.52 | 4,692,594,242.48 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

高阳

迟哲

薄贺龙

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]1447号《关于准予天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2021年09月09日生效，首次设立募集规模为326,894,457.00份基金份额。本基金的运作方式为交易型开放式，存续期限不定。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。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括创业板、存托凭

证及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及2026年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2026年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 10,056,442.70      |
| 等于：本金        | 10,053,067.76      |
| 加：应计利息       | 3,374.94           |
| 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           | 10,056,442.70      |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026年06月30日 |      |                  |                   |
|---------------|-------|--------------------|------|------------------|-------------------|
|               |       | 成本                 | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动            |
| 股票            |       | 6,638,550,694.98   | -    | 4,074,770,464.62 | -2,563,780,230.36 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                  | -    | -                | -                 |
| 债券            | 交易所市场 | -                  | -    | -                | -                 |
|               | 银行间市场 | -                  | -    | -                | -                 |
|               | 合计    | -                  | -    | -                | -                 |
| 资产支持证券        |       | -                  | -    | -                | -                 |
| 基金            |       | -                  | -    | -                | -                 |
| 其他            |       | -                  | -    | -                | -                 |
| 合计            |       | 6,638,550,694.98   | -    | 4,074,770,464.62 | -2,563,780,230.36 |

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026年06月30日 |
|----|--------------------|
|----|--------------------|

|       |           |
|-------|-----------|
| 应收利息  | -         |
| 其他应收款 | -         |
| 待摊费用  | 60,492.63 |
| 合计    | 60,492.63 |

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | -                  |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | 143,279.99         |
| 其中：交易所市场    | 143,279.99         |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 109,095.94         |
| 合计          | 252,375.93         |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                  |
|---------------|-------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额             |
| 上年度末          | 7,902,394,457.00              | 7,902,394,457.00 |
| 本期申购          | 416,000,000.00                | 416,000,000.00   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -904,000,000.00               | -904,000,000.00  |
| 本期末           | 7,414,394,457.00              | 7,414,394,457.00 |

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|----|-------|-------|---------|

|                |                 |                   |                   |
|----------------|-----------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末           | -483,761,577.50 | -1,997,837,333.55 | -2,481,598,911.05 |
| 本期期初           | -483,761,577.50 | -1,997,837,333.55 | -2,481,598,911.05 |
| 本期利润           | -183,625,588.03 | -858,490,149.95   | -1,042,115,737.98 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 38,980,304.03   | 153,806,041.63    | 192,786,345.66    |
| 其中：基金申购款       | -28,155,854.93  | -114,305,063.53   | -142,460,918.46   |
| 基金赎回款          | 67,136,158.96   | 268,111,105.16    | 335,247,264.12    |
| 本期已分配利润        | -               | -                 | -                 |
| 本期末            | -628,406,861.50 | -2,702,521,441.87 | -3,330,928,303.37 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 48,988.23                     |
| 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 | 1,296.08                      |
| 其他        | 1,803.94                      |
| 合计        | 52,088.25                     |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------|-------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -119,938,882.24               |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -124,735,914.16               |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                             |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                             |
| 合计               | -244,674,796.40               |



6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 524,287,782.66                |
| 减：卖出股票成本总额 | 643,714,414.86                |
| 减：交易费用     | 512,250.04                    |
| 买卖股票差价收入   | -119,938,882.24               |

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-------------|-------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 568,752,735.88                |
| 减：现金支付赎回款总额 | 349,374,776.88                |
| 减：赎回股票成本总额  | 344,113,873.16                |
| 减：交易费用      | -                             |
| 赎回差价收入      | -124,735,914.16               |

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期未取得债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 75,331,970.54                 |
| 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            | 75,331,970.54                 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | -858,490,149.95               |
| ——股票投资                 | -858,490,149.95               |
| ——债券投资                 | -                             |
| ——资产支持证券投资             | -                             |
| ——贵金属投资                | -                             |
| ——其他                   | -                             |
| 2.衍生工具                 | -                             |
| ——权证投资                 | -                             |
| 3.其他                   | -                             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                             |
| 合计                     | -858,490,149.95               |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|           | 2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-----------|-------------------------|
| 基金赎回费收入   | -                       |
| 基金转换费收入   | -                       |
| ETF基金替代损益 | 900,857.40              |
| 合计        | 900,857.40              |

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 审计费用      | 39,671.58                     |
| 信息披露费     | 59,507.37                     |
| 证券出借违约金   | -                             |
| IOPV计算发布费 | 9,916.99                      |
| ETF登记结算费  | 59,507.37                     |
| 合计        | 168,603.31                    |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------|---------|
|-------|---------|

|                              |                           |
|------------------------------|---------------------------|
| 天弘基金管理有限公司                   | 基金管理人                     |
| 中信证券股份有限公司                   | 基金托管人、基金销售机构              |
| 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金   | 本基金的联接基金                  |
| 天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF） | 纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |              | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |              |
|------------|-------------------------------|--------------|------------------------------------|--------------|
|            | 成交金额                          | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额                               | 占当期股票成交总额的比例 |
| 中信证券股份有限公司 | 861,623,714.92                | 93.70%       | 643,909,728.25                     | 96.24%       |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

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

| 称          | 2026年01月01日至2026年06月30日            |            |            |              |
|------------|------------------------------------|------------|------------|--------------|
|            | 当期佣金                               | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中信证券股份有限公司 | 179,139.03                         | 93.83%     | 132,469.82 | 92.46%       |
| 关联方名称      | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |            |            |              |
|            | 当期佣金                               | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中信证券股份有限公司 | 133,862.19                         | 96.24%     | 102,709.41 | 95.15%       |

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，以未包含印花税、经手费、证管费和过户费等费用的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 12,555,920.46                 | 11,939,622.27                      |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 292,455.89                    | 80,423.39                          |

|               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|
| 应支付基金管理人的净管理费 | 12,263,464.57 | 11,859,198.88 |
|---------------|---------------|---------------|

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026年01月01日至2026<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,511,184.05                      | 2,387,924.40                           |

注:支付基金托管人中信证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称                        | 本期末<br>2026年06月30日 |                  | 上年度末<br>2025年12月31日 |                  |
|------------------------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|                              | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金   | 6,815,805,200.00   | 91.93%           | 7,218,977,500.00    | 91.35%           |
| 中信证券股份有限公司                   | 1,846,698.00       | 0.02%            | 7,186,198.00        | 0.09%            |
| 天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF） | 351,100.00         | 0.00%            | 351,100.00          | 0.00%            |

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |        | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |        |
|-------|-------------------------------|--------|------------------------------------|--------|
|       | 期末余额                          | 当期利息收入 | 期末余额                               | 当期利息收入 |

|                    |               |           |              |           |
|--------------------|---------------|-----------|--------------|-----------|
| 中信证券<br>股份有限<br>公司 | 10,056,442.70 | 48,988.23 | 9,641,874.05 | 43,756.95 |
|--------------------|---------------|-----------|--------------|-----------|

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |        |      |      |            |            |
|-------------------------------|--------|------|------|------------|------------|
| 关联方名称                         | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入  |            |
|                               |        |      |      | 数量（单位：张/股） | 总金额        |
| 中信证券股份有限公司                    | 688785 | 恒运昌  | 网下申购 | 1,155      | 106,467.90 |
| 中信证券股份有限公司                    | 301683 | 慧谷新材 | 网下申购 | 952        | 74,617.76  |
| 中信证券股份有限公司                    | 688811 | 有研复材 | 网下申购 | 8,337      | 53,440.17  |
| 中信证券股份有限公司                    | 688820 | 盛合晶微 | 网下申购 | 23,902     | 470,391.36 |
| 中信证券股份有限公司                    | 001312 | 福恩股份 | 网下申购 | 1,333      | 24,500.54  |
| 中信证券股份有限公司                    | 688808 | 联讯仪器 | 网下申购 | 1,624      | 132,973.12 |
| 中信证券股份有限公司                    | 301669 | 高特电子 | 网下申购 | 5,455      | 38,621.40  |



| 公司                                 |        |       |      |            |            |
|------------------------------------|--------|-------|------|------------|------------|
| 中信证券股份有限公司                         | 001248 | 华润新能源 | 网下申购 | 84,104     | 850,291.44 |
| 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |        |       |      |            |            |
| 关联方名称                              | 证券代码   | 证券名称  | 发行方式 | 基金在承销期内买入  |            |
|                                    |        |       |      | 数量（单位：张/股） | 总金额        |
| 中信证券股份有限公司                         | 603124 | 江南新材  | 网下申购 | 879        | 9,264.66   |
| 中信证券股份有限公司                         | 603257 | 中国瑞林  | 网下申购 | 780        | 16,005.60  |
| 中信证券股份有限公司                         | 301662 | 宏工科技  | 网下申购 | 1,429      | 38,011.40  |
| 中信建投证券股份有限公司                       | 603202 | 天有为   | 网下申购 | 1,657      | 154,929.50 |

注：中信建投证券股份有限公司为托管人的重要关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

|                      |
|----------------------|
| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |
|----------------------|

| 证券代码   | 证券名称  | 成功认购日      | 受限期     | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价   | 数量<br>(单位:股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
|--------|-------|------------|---------|--------|-------|----------|--------------|------------|------------|----|
| 001248 | 华润新能源 | 2026-06-24 | 6个月     | 新股流通受限 | 10.11 | 10.11    | 58,873       | 595,206.03 | 595,206.03 | -  |
| 301666 | 大普微   | 2026-04-08 | 6个月     | 新股流通受限 | 46.08 | 463.33   | 1,220        | 56,217.60  | 565,262.60 | -  |
| 688820 | 盛合晶微  | 2026-04-13 | 6个月     | 新股流通受限 | 19.68 | 141.49   | 2,391        | 47,054.88  | 338,302.59 | -  |
| 688808 | 联讯仪器  | 2026-04-16 | 6个月     | 新股流通受限 | 81.88 | 1,584.33 | 163          | 13,346.44  | 258,245.79 | -  |
| 001248 | 华润新能源 | 2026-06-24 | 1个月内(含) | 新股未上市  | 10.11 | 10.11    | 25,231       | 255,085.41 | 255,085.41 | -  |
| 001399 | C惠科   | 2026-06-16 | 6个月     | 新股流通受限 | 10.12 | 27.73    | 6,488        | 65,658.56  | 179,912.24 | -  |
| 688818 | 电科蓝天  | 2026-02-03 | 6个月     | 新股流通受限 | 9.47  | 70.14    | 1,717        | 16,259.99  | 120,430.38 | -  |
| 301682 | 宏明电子  | 2026-03-18 | 6个月     | 新股流通受限 | 69.66 | 160.06   | 714          | 49,737.24  | 114,282.84 | -  |
| 688781 | 视涯科技  | 2026-03-18 | 6个月     | 新股流通受限 | 22.68 | 47.61    | 1,300        | 29,484.00  | 61,893.00  | -  |
| 688712 | 北芯生命  | 2026-01-28 | 6个月     | 新股流通受限 | 17.52 | 35.92    | 1,500        | 26,280.00  | 53,880.00  | -  |

|        |      |            |     |        |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 688785 | 恒运昌  | 2026-01-20 | 6个月 | 新股流通受限 | 92.18 | 463.15 | 116   | 10,692.88 | 53,725.40 | - |
| 688813 | 泰金新能 | 2026-03-24 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.28 | 172.09 | 234   | 6,149.52  | 40,269.06 | - |
| 688635 | 长进光子 | 2026-05-20 | 6个月 | 新股流通受限 | 40.98 | 308.19 | 128   | 5,245.44  | 39,448.32 | - |
| 001257 | 盛龙股份 | 2026-03-24 | 6个月 | 新股流通受限 | 7.82  | 20.74  | 1,743 | 13,630.26 | 36,149.82 | - |
| 603459 | 红板科技 | 2026-03-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.70 | 84.32  | 330   | 5,841.00  | 27,825.60 | - |
| 001365 | 天海电子 | 2026-05-11 | 6个月 | 新股流通受限 | 27.19 | 31.31  | 719   | 19,549.61 | 22,511.89 | - |
| 688811 | 有研新材 | 2026-04-01 | 6个月 | 新股流通受限 | 6.41  | 24.13  | 834   | 5,345.94  | 20,124.42 | - |
| 301696 | 三瑞智能 | 2026-03-31 | 6个月 | 新股流通受限 | 24.68 | 86.80  | 216   | 5,330.88  | 18,748.80 | - |
| 001237 | 惠康科技 | 2026-05-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 53.26 | 58.74  | 285   | 15,179.10 | 16,740.90 | - |
| 301669 | 高特电子 | 2026-06-02 | 6个月 | 新股流通受限 | 7.08  | 28.40  | 546   | 3,865.68  | 15,506.40 | - |
| 301687 | 新广益  | 2025-12-24 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.93 | 77.78  | 195   | 4,276.35  | 15,167.10 | - |

|        |      |            |     |        |       |        |     |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|--------|-----|-----------|-----------|---|
| 001393 | 维通利  | 2026-05-08 | 6个月 | 新股流通受限 | 30.38 | 38.99  | 387 | 11,757.06 | 15,089.13 | - |
| 301531 | 春光集团 | 2026-04-28 | 6个月 | 新股流通受限 | 13.30 | 51.56  | 290 | 3,857.00  | 14,952.40 | - |
| 301599 | 理奇智能 | 2026-04-22 | 6个月 | 新股流通受限 | 13.91 | 32.47  | 433 | 6,023.03  | 14,059.51 | - |
| 601112 | 振石股份 | 2026-01-21 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.18 | 17.59  | 775 | 8,664.50  | 13,632.25 | - |
| 301680 | 固德电材 | 2026-02-27 | 6个月 | 新股流通受限 | 58.00 | 112.16 | 117 | 6,786.00  | 13,122.72 | - |
| 301683 | 慧谷新材 | 2026-03-24 | 6个月 | 新股流通受限 | 78.38 | 121.77 | 96  | 7,524.48  | 11,689.92 | - |
| 688816 | 易思维  | 2026-02-04 | 6个月 | 新股流通受限 | 55.95 | 57.10  | 177 | 9,903.15  | 10,106.70 | - |
| 603407 | 长裕集团 | 2026-04-29 | 6个月 | 新股流通受限 | 13.86 | 73.46  | 137 | 1,898.82  | 10,064.02 | - |
| 301513 | 尚水智能 | 2026-04-10 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.66 | 50.96  | 138 | 3,679.08  | 7,032.48  | - |
| 603435 | 嘉德利  | 2026-05-15 | 6个月 | 新股流通受限 | 15.76 | 46.71  | 104 | 1,639.04  | 4,857.84  | - |
| 603352 | 至信股份 | 2026-01-08 | 6个月 | 新股流通受限 | 21.88 | 25.52  | 112 | 2,450.56  | 2,858.24  | - |

|        |      |            |     |        |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 603293 | 埃泰克  | 2026-04-09 | 6个月 | 新股流通受限 | 33.49 | 33.93 | 72  | 2,411.28 | 2,442.96 | - |
| 001312 | 福恩股份 | 2026-04-14 | 6个月 | 新股流通受限 | 18.38 | 16.78 | 134 | 2,462.92 | 2,248.52 | - |
| 603284 | 林平发展 | 2026-02-03 | 6个月 | 新股流通受限 | 37.88 | 34.87 | 46  | 1,742.48 | 1,604.02 | - |
| 001220 | 世盟股份 | 2026-01-27 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.00 | 27.78 | 57  | 1,596.00 | 1,583.46 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权

重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金管理人按照“全面管理、专业分工、各司其职”的思路，明确风险管理职责并将其融入组织架构、写入制度、嵌入系统，实施多层次、多角度、全方位的风险管理。一是投资决策实施分层授权管理，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，根据不同权限实施风险控制；二是按照部门职能执行分工管理，基金经理、中央交易室、研究相关部门、风险管理部、内控合规部、基金运营部等从不同角度、不同环节对投资全过程实行风险监控和管理；三是投资到结算的全流程，已经形成了一套贯穿“事前风险定位、事中风险管理和事后风险评估”的健全风险监控体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中信证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金于报告期末的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026年06月30日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计            |
|--------------------|---------------|------|------|-----|---------------|
| 资产                 |               |      |      |     |               |
| 货币资金               | 10,056,442.70 | -    | -    | -   | 10,056,442.70 |
| 结算备付金              | 1,102,441.09  | -    | -    | -   | 1,102,441.09  |



|                     |               |      |      |                  |                  |
|---------------------|---------------|------|------|------------------|------------------|
| 存出保证金               | 810,166.41    | -    | -    | -                | 810,166.41       |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 4,074,770,464.62 | 4,074,770,464.62 |
| 应收清算款               | -             | -    | -    | 4,222,284.63     | 4,222,284.63     |
| 其他资产                | -             | -    | -    | 60,492.63        | 60,492.63        |
| 资产总计                | 11,969,050.20 | -    | -    | 4,079,053,241.88 | 4,091,022,292.08 |
| 负债                  |               |      |      |                  |                  |
| 应付清算款               | -             | -    | -    | 5,163,414.99     | 5,163,414.99     |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 1,783,622.93     | 1,783,622.93     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 356,724.60       | 356,724.60       |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 252,375.93       | 252,375.93       |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 7,556,138.45     | 7,556,138.45     |
| 利率敏感度缺口             | 11,969,050.20 | -    | -    | 4,071,497,103.43 | 4,083,466,153.63 |
| 上年度末<br>2025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                | 5,163,718.42  | -    | -    | -                | 5,163,718.42     |
| 结算备付金               | 1,289,276.67  | -    | -    | -                | 1,289,276.67     |
| 存出保证金               | 1,296,991.26  | -    | -    | -                | 1,296,991.26     |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -    | 5,415,936,308.31 | 5,415,936,308.31 |
| 应收清算款               | -             | -    | -    | 5,848,590.10     | 5,848,590.10     |
| 资产总计                | 7,749,986.35  | -    | -    | 5,421,784,898.41 | 5,429,534,884.76 |
| 负债                  |               |      |      |                  |                  |
| 应付清算款               | -             | -    | -    | 5,617,243.79     | 5,617,243.79     |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -    | 2,338,595.62     | 2,338,595.62     |
| 应付托管费               | -             | -    | -    | 467,719.16       | 467,719.16       |
| 其他负债                | -             | -    | -    | 315,780.24       | 315,780.24       |
| 负债总计                | -             | -    | -    | 8,739,338.81     | 8,739,338.81     |
| 利率敏感度缺口             | 7,749,986.35  | -    | -    | 5,413,045,559.60 | 5,420,795,545.95 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年06月30日，本基金未持有交易性债券投资 (2025年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目               | 本期末<br>2026年06月30日 |                          | 上年度末<br>2025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<br>产—股票投资 | 4,074,770,464.62   | 99.79                    | 5,415,936,308.31    | 99.91                    |
| 交易性金融资<br>产—基金投资 | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资           | -                  | -                        | -                   | -                        |

|             |                  |       |                  |       |
|-------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 产—贵金属投资     |                  |       |                  |       |
| 衍生金融资产—权证投资 | -                | -     | -                | -     |
| 其他          | -                | -     | -                | -     |
| 合计          | 4,074,770,464.62 | 99.79 | 5,415,936,308.31 | 99.91 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 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>2026年06月30日          | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|    | 业绩比较基准上升5%           | 198,485,046.97              | 268,861,833.49      |
|    | 业绩比较基准下降5%           | -198,485,046.97             | -268,861,833.49     |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 4,071,796,401.86   | 5,411,814,364.61    |
| 第二层次          | 850,291.44         | -                   |
| 第三层次          | 2,123,771.32       | 4,121,943.70        |

|    |                  |                  |
|----|------------------|------------------|
| 合计 | 4,074,770,464.62 | 5,415,936,308.31 |
|----|------------------|------------------|

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额               | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | 4,074,770,464.62 | 99.60        |
|    | 其中：股票  | 4,074,770,464.62 | 99.60        |
| 2  | 基金投资   | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资 | -                | -            |
|    | 其中：债券  | -                | -            |
|    | 资产支持证券 | -                | -            |
| 4  | 贵金属投资  | -                | -            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 5 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 11,158,883.79    | 0.27   |
| 8 | 其他各项资产            | 5,092,943.67     | 0.12   |
| 9 | 合计                | 4,091,022,292.08 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|------------------|------------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -                | -                |
| B  | 采矿业              | -                | -                |
| C  | 制造业              | 4,041,975,211.06 | 98.98            |
| 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           | 29,820,254.00    | 0.73             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -                |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -                | -                |
| J  | 金融业              | -                | -                |
| K  | 房地产业             | -                | -                |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -                |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -                | -                |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -                | -                |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -                |
| P  | 教育               | -                | -                |

|   |           |                  |       |
|---|-----------|------------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作   | -                | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -                | -     |
| S | 综合        | -                | -     |
|   | 合计        | 4,071,795,465.06 | 99.71 |

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|------------------|--------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -                |
| B  | 采矿业              | 36,149.82    | 0.00             |
| C  | 制造业              | 2,086,038.04 | 0.05             |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 850,291.44   | 0.02             |
| E  | 建筑业              | -            | -                |
| F  | 批发和零售业           | -            | -                |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,583.46     | 0.00             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -            | -                |
| J  | 金融业              | -            | -                |
| K  | 房地产业             | -            | -                |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -                |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -                |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -                |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -                |
| P  | 教育               | -            | -                |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -                |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -                |
| S  | 综合               | 936.80       | 0.00             |
|    | 合计               | 2,974,999.56 | 0.07             |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1  | 600887 | 伊利股份 | 16,927,884 | 405,592,100.64 | 9.93         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 339,935    | 402,989,543.15 | 9.87         |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 5,370,193  | 397,394,282.00 | 9.73         |
| 4  | 000568 | 泸州老窖 | 2,879,799  | 223,242,018.48 | 5.47         |
| 5  | 603288 | 海天味业 | 6,527,861  | 216,463,870.76 | 5.30         |
| 6  | 600809 | 山西汾酒 | 1,910,099  | 208,907,527.63 | 5.12         |
| 7  | 605499 | 东鹏饮料 | 1,055,051  | 130,224,944.93 | 3.19         |
| 8  | 603156 | 养元饮品 | 1,973,500  | 96,839,645.00  | 2.37         |
| 9  | 000895 | 双汇发展 | 4,067,775  | 91,118,160.00  | 2.23         |
| 10 | 002304 | 洋河股份 | 2,358,982  | 89,995,163.30  | 2.20         |
| 11 | 600298 | 安琪酵母 | 2,378,199  | 86,090,803.80  | 2.11         |
| 12 | 600186 | 莲花控股 | 5,613,200  | 78,584,800.00  | 1.92         |
| 13 | 600600 | 青岛啤酒 | 1,387,141  | 72,450,374.43  | 1.77         |
| 14 | 603369 | 今世缘  | 2,927,467  | 69,410,242.57  | 1.70         |
| 15 | 603345 | 安井食品 | 803,800    | 64,456,722.00  | 1.58         |
| 16 | 000729 | 燕京啤酒 | 5,515,100  | 55,867,963.00  | 1.37         |
| 17 | 300999 | 金龙鱼  | 2,334,600  | 54,302,796.00  | 1.33         |
| 18 | 600737 | 中粮糖业 | 4,185,900  | 51,612,147.00  | 1.26         |
| 19 | 000596 | 古井贡酒 | 639,100    | 51,000,180.00  | 1.25         |
| 20 | 002515 | 金字火腿 | 4,737,600  | 47,423,376.00  | 1.16         |
| 21 | 300765 | 石药创新 | 1,649,910  | 44,927,049.30  | 1.10         |
| 22 | 600872 | 中炬高新 | 2,423,300  | 42,068,488.00  | 1.03         |
| 23 | 600132 | 重庆啤酒 | 946,200    | 39,078,060.00  | 0.96         |
| 24 | 000799 | 酒鬼酒  | 890,960    | 38,934,952.00  | 0.95         |

|    |        |       |           |               |      |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 25 | 300146 | 汤臣倍健  | 3,971,800 | 35,905,072.00 | 0.88 |
| 26 | 002568 | 百润股份  | 2,034,252 | 34,419,543.84 | 0.84 |
| 27 | 002507 | 涪陵榨菜  | 3,160,210 | 34,130,268.00 | 0.84 |
| 28 | 600702 | 舍得酒业  | 912,500   | 32,439,375.00 | 0.79 |
| 29 | 600559 | 老白干酒  | 2,863,300 | 32,068,960.00 | 0.79 |
| 30 | 603589 | 口子窖   | 1,639,300 | 30,622,124.00 | 0.75 |
| 31 | 603198 | 迎驾贡酒  | 938,400   | 27,776,640.00 | 0.68 |
| 32 | 002597 | 金禾实业  | 1,333,700 | 26,140,520.00 | 0.64 |
| 33 | 600779 | 水井坊   | 763,200   | 21,629,088.00 | 0.53 |
| 34 | 002557 | 洽洽食品  | 1,188,100 | 21,338,276.00 | 0.52 |
| 35 | 605016 | 百龙创园  | 822,324   | 21,257,075.40 | 0.52 |
| 36 | 000860 | 顺鑫农业  | 2,032,650 | 19,919,970.00 | 0.49 |
| 37 | 002847 | 盐津铺子  | 427,209   | 19,053,521.40 | 0.47 |
| 38 | 600962 | 国投中鲁  | 615,100   | 18,557,567.00 | 0.45 |
| 39 | 600059 | 古越龙山  | 2,496,700 | 18,275,844.00 | 0.45 |
| 40 | 603027 | 千禾味业  | 2,608,430 | 18,180,757.10 | 0.45 |
| 41 | 000848 | 承德露露  | 2,395,780 | 17,728,772.00 | 0.43 |
| 42 | 002570 | 贝因美   | 4,227,800 | 16,826,644.00 | 0.41 |
| 43 | 600597 | 光明乳业  | 2,697,700 | 16,375,039.00 | 0.40 |
| 44 | 600305 | XD恒顺醋 | 2,593,656 | 16,365,969.36 | 0.40 |
| 45 | 603317 | 天味食品  | 1,250,660 | 16,271,086.60 | 0.40 |
| 46 | 600882 | 妙可蓝多  | 997,400   | 15,948,426.00 | 0.39 |
| 47 | 002216 | 三全食品  | 1,375,900 | 15,864,127.00 | 0.39 |
| 48 | 002626 | 金达威   | 1,193,900 | 15,735,602.00 | 0.39 |
| 49 | 300783 | 三只松鼠  | 942,200   | 14,886,760.00 | 0.36 |
| 50 | 603020 | 爱普股份  | 1,028,600 | 14,503,260.00 | 0.36 |
| 51 | 002946 | 新乳业   | 1,010,000 | 14,220,800.00 | 0.35 |
| 52 | 601579 | 会稽山   | 937,200   | 13,767,468.00 | 0.34 |
| 53 | 002840 | 华统股份  | 1,883,800 | 13,732,902.00 | 0.34 |
| 54 | 605198 | 安德利   | 214,500   | 13,590,720.00 | 0.33 |
| 55 | 002461 | 珠江啤酒  | 1,731,600 | 13,108,212.00 | 0.32 |



|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 56 | 002956 | 西麦食品 | 610,960   | 12,683,529.60 | 0.31 |
| 57 | 600189 | 泉阳泉  | 1,678,610 | 12,639,933.30 | 0.31 |
| 58 | 600199 | 金种子酒 | 2,058,900 | 12,579,879.00 | 0.31 |
| 59 | 600300 | 维维股份 | 4,430,500 | 12,494,010.00 | 0.31 |
| 60 | 600784 | 鲁银投资 | 1,851,200 | 12,032,800.00 | 0.29 |
| 61 | 600073 | 光明肉业 | 2,568,500 | 11,969,210.00 | 0.29 |
| 62 | 603919 | 金徽酒  | 794,200   | 11,952,710.00 | 0.29 |
| 63 | 000523 | 红棉股份 | 4,309,760 | 11,119,180.80 | 0.27 |
| 64 | 603043 | 广州酒家 | 890,994   | 11,048,325.60 | 0.27 |
| 65 | 002481 | 双塔食品 | 2,896,100 | 10,976,219.00 | 0.27 |
| 66 | 603057 | 紫燕食品 | 484,300   | 10,799,890.00 | 0.26 |
| 67 | 600197 | 伊力特  | 1,111,072 | 10,666,291.20 | 0.26 |
| 68 | 003000 | 劲仔食品 | 1,058,400 | 10,435,824.00 | 0.26 |
| 69 | 002286 | 保龄宝  | 1,191,800 | 9,832,350.00  | 0.24 |
| 70 | 300973 | 立高食品 | 397,800   | 9,773,946.00  | 0.24 |
| 71 | 300858 | 科拓生物 | 618,000   | 9,387,420.00  | 0.23 |
| 72 | 603866 | 桃李面包 | 2,503,771 | 9,213,877.28  | 0.23 |
| 73 | 605077 | 华康股份 | 829,800   | 8,970,138.00  | 0.22 |
| 74 | 002695 | 煌上煌  | 875,500   | 8,886,325.00  | 0.22 |
| 75 | 301206 | 三元生物 | 396,100   | 8,805,303.00  | 0.22 |
| 76 | 300829 | 金丹科技 | 622,100   | 8,541,433.00  | 0.21 |
| 77 | 001215 | 千味央厨 | 231,100   | 8,527,590.00  | 0.21 |
| 78 | 000716 | 黑芝麻  | 2,061,700 | 8,329,268.00  | 0.20 |
| 79 | 001338 | 永顺泰  | 981,200   | 8,232,268.00  | 0.20 |
| 80 | 603777 | 来伊份  | 524,300   | 8,142,379.00  | 0.20 |
| 81 | 300791 | 仙乐健康 | 483,631   | 7,747,768.62  | 0.19 |
| 82 | 600429 | 三元股份 | 1,763,100 | 7,122,924.00  | 0.17 |
| 83 | 002646 | 天佑德酒 | 1,125,100 | 7,099,381.00  | 0.17 |
| 84 | 300997 | 欢乐家  | 511,356   | 6,928,873.80  | 0.17 |
| 85 | 603719 | 良品铺子 | 785,100   | 6,791,115.00  | 0.17 |
| 86 | 605338 | 巴比食品 | 375,200   | 6,716,080.00  | 0.16 |

|     |        |      |           |              |      |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 87  | 000505 | 京粮控股 | 1,294,100 | 6,509,323.00 | 0.16 |
| 88  | 603697 | 有友食品 | 669,300   | 6,418,587.00 | 0.16 |
| 89  | 300741 | 华宝股份 | 482,400   | 6,039,648.00 | 0.15 |
| 90  | 605179 | 一鸣食品 | 471,100   | 5,921,727.00 | 0.15 |
| 91  | 002991 | 甘源食品 | 147,800   | 5,839,578.00 | 0.14 |
| 92  | 002852 | 道道全  | 808,000   | 5,728,720.00 | 0.14 |
| 93  | 300898 | 熊猫乳品 | 295,300   | 5,350,836.00 | 0.13 |
| 94  | 603696 | 安记食品 | 460,300   | 5,293,450.00 | 0.13 |
| 95  | 605337 | 李子园  | 610,230   | 5,003,886.00 | 0.12 |
| 96  | 605388 | 均瑶健康 | 938,888   | 4,534,829.04 | 0.11 |
| 97  | 001318 | 阳光乳业 | 442,200   | 4,382,202.00 | 0.11 |
| 98  | 688089 | 嘉必优  | 393,533   | 4,175,385.13 | 0.10 |
| 99  | 603711 | 香飘飘  | 323,000   | 3,588,530.00 | 0.09 |
| 100 | 920273 | 一致魔芋 | 163,900   | 2,946,922.00 | 0.07 |

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量(股)  | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|--------|------------|--------------|
| 1  | 001248 | 华润新能源 | 84,104 | 850,291.44 | 0.02         |
| 2  | 301666 | 大普微   | 1,220  | 565,262.60 | 0.01         |
| 3  | 688820 | 盛合晶微  | 2,391  | 338,302.59 | 0.01         |
| 4  | 688808 | 联讯仪器  | 163    | 258,245.79 | 0.01         |
| 5  | 001399 | C惠科   | 6,488  | 179,912.24 | 0.00         |
| 6  | 688818 | 电科蓝天  | 1,717  | 120,430.38 | 0.00         |
| 7  | 301682 | 宏明电子  | 714    | 114,282.84 | 0.00         |
| 8  | 688781 | 视涯科技  | 1,300  | 61,893.00  | 0.00         |
| 9  | 688712 | 北芯生命  | 1,500  | 53,880.00  | 0.00         |
| 10 | 688785 | 恒运昌   | 116    | 53,725.40  | 0.00         |
| 11 | 688813 | 泰金新能  | 234    | 40,269.06  | 0.00         |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 12 | 688635 | 长进光子 | 128   | 39,448.32 | 0.00 |
| 13 | 001257 | 盛龙股份 | 1,743 | 36,149.82 | 0.00 |
| 14 | 603459 | 红板科技 | 330   | 27,825.60 | 0.00 |
| 15 | 001365 | 天海电子 | 719   | 22,511.89 | 0.00 |
| 16 | 688811 | 有研复材 | 834   | 20,124.42 | 0.00 |
| 17 | 301696 | 三瑞智能 | 216   | 18,748.80 | 0.00 |
| 18 | 001237 | 惠康科技 | 285   | 16,740.90 | 0.00 |
| 19 | 301669 | 高特电子 | 546   | 15,506.40 | 0.00 |
| 20 | 301687 | 新广益  | 195   | 15,167.10 | 0.00 |
| 21 | 001393 | 维通利  | 387   | 15,089.13 | 0.00 |
| 22 | 301531 | 春光集团 | 290   | 14,952.40 | 0.00 |
| 23 | 301599 | 理奇智能 | 433   | 14,059.51 | 0.00 |
| 24 | 601112 | 振石股份 | 775   | 13,632.25 | 0.00 |
| 25 | 301680 | 固德电材 | 117   | 13,122.72 | 0.00 |
| 26 | 301683 | 慧谷新材 | 96    | 11,689.92 | 0.00 |
| 27 | 688816 | 易思维  | 177   | 10,106.70 | 0.00 |
| 28 | 603407 | 长裕集团 | 137   | 10,064.02 | 0.00 |
| 29 | 301513 | 尚水智能 | 138   | 7,032.48  | 0.00 |
| 30 | 603435 | 嘉德利  | 104   | 4,857.84  | 0.00 |
| 31 | 603352 | 至信股份 | 112   | 2,858.24  | 0.00 |
| 32 | 603293 | 埃泰克  | 72    | 2,442.96  | 0.00 |
| 33 | 001312 | 福恩股份 | 134   | 2,248.52  | 0.00 |
| 34 | 603284 | 林平发展 | 46    | 1,604.02  | 0.00 |
| 35 | 001220 | 世盟股份 | 57    | 1,583.46  | 0.00 |
| 36 | 000833 | 粤桂股份 | 40    | 936.80    | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比 |
|----|------|------|----------|------------|
|----|------|------|----------|------------|

|    |        |       |               | 例(%) |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 1  | 000858 | 五 粮 液 | 65,522,820.94 | 1.21 |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 34,891,572.71 | 0.64 |
| 3  | 600887 | 伊利股份  | 31,751,960.24 | 0.59 |
| 4  | 600809 | 山西汾酒  | 21,253,482.60 | 0.39 |
| 5  | 603288 | 海天味业  | 18,765,345.28 | 0.35 |
| 6  | 603020 | 爱普股份  | 13,307,408.00 | 0.25 |
| 7  | 605499 | 东鹏饮料  | 12,907,072.30 | 0.24 |
| 8  | 002286 | 保龄宝   | 11,082,955.00 | 0.20 |
| 9  | 300829 | 金丹科技  | 10,180,953.00 | 0.19 |
| 10 | 001215 | 千味央厨  | 9,910,346.00  | 0.18 |
| 11 | 600600 | 青岛啤酒  | 7,460,864.11  | 0.14 |
| 12 | 600298 | 安琪酵母  | 6,918,607.00  | 0.13 |
| 13 | 603369 | 今世缘   | 6,843,064.00  | 0.13 |
| 14 | 000568 | 泸州老窖  | 6,783,815.50  | 0.13 |
| 15 | 002852 | 道道全   | 6,322,560.00  | 0.12 |
| 16 | 300898 | 熊猫乳品  | 5,962,563.00  | 0.11 |
| 17 | 603696 | 安记食品  | 5,914,506.00  | 0.11 |
| 18 | 002840 | 华统股份  | 5,380,086.00  | 0.10 |
| 19 | 603345 | 安井食品  | 5,265,197.20  | 0.10 |
| 20 | 603156 | 养元饮品  | 5,165,202.00  | 0.10 |

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 98,011,503.84 | 1.81           |
| 2  | 600887 | 伊利股份 | 88,945,846.45 | 1.64           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 3  | 000833 | 粤桂股份 | 39,673,285.20 | 0.73 |
| 4  | 600809 | 山西汾酒 | 31,523,902.06 | 0.58 |
| 5  | 603288 | 海天味业 | 29,070,816.88 | 0.54 |
| 6  | 600186 | 莲花控股 | 24,061,773.96 | 0.44 |
| 7  | 605499 | 东鹏饮料 | 19,479,153.93 | 0.36 |
| 8  | 600600 | 青岛啤酒 | 10,966,429.53 | 0.20 |
| 9  | 600298 | 安琪酵母 | 10,558,907.29 | 0.19 |
| 10 | 603369 | 今世缘  | 10,226,834.00 | 0.19 |
| 11 | 603156 | 养元饮品 | 8,787,493.67  | 0.16 |
| 12 | 603345 | 安井食品 | 8,476,226.00  | 0.16 |
| 13 | 600737 | 中粮糖业 | 7,217,442.00  | 0.13 |
| 14 | 300908 | 仲景食品 | 7,124,054.22  | 0.13 |
| 15 | 600132 | 重庆啤酒 | 7,089,285.90  | 0.13 |
| 16 | 603237 | 五芳斋  | 6,325,112.00  | 0.12 |
| 17 | 000639 | ST西王 | 6,236,411.00  | 0.12 |
| 18 | 600872 | 中炬高新 | 5,392,016.00  | 0.10 |
| 19 | 002726 | ST龙大 | 5,354,849.00  | 0.10 |
| 20 | 605300 | 佳禾食品 | 5,334,563.99  | 0.10 |

注：本项的"卖出金额"均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 398,744,457.28 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 524,287,782.66 |

注：本项 "买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同约定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 810,166.41   |
| 2  | 应收清算款 | 4,222,284.63 |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | -            |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | 60,492.63    |
| 8  | 其他    | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 5,092,943.67 |
|---|----|--------------|

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 流通受限部分的<br>公允价值 | 占基金资产<br>净值比例(%) | 流通受限情况说<br>明 |
|----|--------|-------|-----------------|------------------|--------------|
| 1  | 001248 | 华润新能源 | 850,291.44      | 0.02             | 新股未上市        |
| 2  | 301666 | 大普微   | 565,262.60      | 0.01             | 新股流通受限       |
| 3  | 688820 | 盛合晶微  | 338,302.59      | 0.01             | 新股流通受限       |
| 4  | 688808 | 联讯仪器  | 258,245.79      | 0.01             | 新股流通受限       |
| 5  | 001399 | C惠科   | 179,912.24      | 0.00             | 新股流通受限       |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构 |                |       |                |      |                |
|------------------|---------------|-------|----------------|-------|----------------|------|----------------|
|                  |               | 机构投资者 |                | 个人投资者 |                | 联接基金 |                |
|                  |               | 持有份额  | 占总<br>份额<br>比例 | 持有份额  | 占总<br>份额<br>比例 | 持有份额 | 占总<br>份额<br>比例 |

|        |            |                |       |                |       |                  |        |
|--------|------------|----------------|-------|----------------|-------|------------------|--------|
| 11,568 | 640,940.05 | 113,930,932.00 | 1.54% | 484,658,325.00 | 6.54% | 6,815,805,200.00 | 91.93% |
|--------|------------|----------------|-------|----------------|-------|------------------|--------|

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 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                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2021年09月09日)基金份额总额 | 326,894,457.00   |
| 本报告期期初基金份额总额               | 7,902,394,457.00 |
| 本报告期基金总申购份额                | 416,000,000.00   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 904,000,000.00   |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 7,414,394,457.00 |

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，宋永明先生担任公司副总经理，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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼



本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。  
本报告期内无其他涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

| 管理人受调查或处罚等情况          | 内容                                               |
|-----------------------|--------------------------------------------------|
| 受到调查或处罚等措施的主体         | 天弘基金管理有限公司                                       |
| 受到调查或处罚等措施的时间         | 2026年06月26日                                      |
| 采取调查或处罚等措施的机构         | 国家外汇管理局天津市分局                                     |
| 受到调查或处罚等措施类型          | 行政处罚                                             |
| 受到的具体措施类型             | 警告、罚款                                            |
| 受到调查或处罚等措施的原因         | 其他问题（报告报送的部分内容缺失）                                |
| 受到处罚的依据               | 《中华人民共和国外汇管理条例》                                  |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 基金管理人已通过补充报送、优化流程等方式完成整改，整改成果已经国家外汇管理局天津市分局验收通过。 |
| 其他                    | -                                                |

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称   | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|--------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|        |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东方财富证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国联民生证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 华泰证券   | 2      | 50,569,694.05  | 5.50%        | 10,514.03  | 5.51%      | -  |
| 民生证券   | 1      | 3,186,722.84   | 0.35%        | 404.61     | 0.21%      | -  |
| 天风证券   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中国银河证券 | 1      | 4,176,335.05   | 0.45%        | 868.26     | 0.45%      | -  |
| 中信证券   | 7      | 861,623,714.92 | 93.70%       | 179,139.03 | 93.83%     | -  |

注：1、交易单元的选择标准：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

2、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，确定选用交易单元的证券公司，再和被选用的证券公司签订证券交易单元租用协议和综合服务协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：华泰证券上海交易单元1个，华泰证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                          | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|-----------------------------------------------|-----------|------------|
| 1  | 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金2025年第4季度报告             | 中国证监会规定媒介 | 2026-01-22 |
| 2  | 天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告                     | 中国证监会规定媒介 | 2026-01-22 |
| 3  | 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）               | 中国证监会规定媒介 | 2026-03-07 |
| 4  | 天弘基金管理有限公司关于天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2026-03-13 |
| 5  | 天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告                     | 中国证监会规定媒介 | 2026-03-26 |
| 6  | 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金2025年年度报告               | 中国证监会规定媒介 | 2026-03-31 |
| 7  | 天弘基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）     | 中国证监会规定媒介 | 2026-03-31 |
| 8  | 天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告                     | 中国证监会规定媒介 | 2026-04-03 |
| 9  | 天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告                     | 中国证监会规定媒介 | 2026-04-15 |
| 10 | 天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公                      | 中国证监会规定媒介 | 2026-04-16 |

|    |                                               |           |            |
|----|-----------------------------------------------|-----------|------------|
|    | 告                                             |           |            |
| 11 | 天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告                     | 中国证监会规定媒介 | 2026-04-18 |
| 12 | 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金2026年第1季度报告             | 中国证监会规定媒介 | 2026-04-22 |
| 13 | 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 | 2026-04-27 |
| 14 | 2025年度天弘基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露   | 中国证监会规定媒介 | 2026-04-30 |
| 15 | 天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告             | 中国证监会规定媒介 | 2026-05-20 |
| 16 | 天弘基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2026-05-29 |
| 17 | 天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告                     | 中国证监会规定媒介 | 2026-06-04 |
| 18 | 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 | 2026-06-13 |
| 19 | 天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告             | 中国证监会规定媒介 | 2026-06-17 |
| 20 | 天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）            | 中国证监会规定媒介 | 2026-06-26 |
| 21 | 天弘基金管理有限公司关于                                  | 中国证监会规定媒介 | 2026-06-26 |

|  |                   |  |  |
|--|-------------------|--|--|
|  | 旗下基金关联交易事项的公<br>告 |  |  |
|--|-------------------|--|--|

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                  |               |                | 报告期末持有基金情况       |        |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|------------------|---------------|----------------|------------------|--------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额          | 赎回份额           | 持有份额             | 份额占比   |
| 联接基金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 1              | 20260101-20260630      | 7,218,977,500.00 | 71,592,600.00 | 474,764,900.00 | 6,815,805,200.00 | 91.93% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                |                        |                  |               |                |                  |        |
| <p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>（1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>（2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>（3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>（4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>（5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p> |                |                        |                  |               |                |                  |        |

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

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

### 12.3 查阅方式

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

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二六年八月三十一日