

# 华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开 放式指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
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.....	44
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51

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 .....	51
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 .....	51
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 .....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	54
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华宝中证细分食品饮料产业主题 ETF
场内简称	食品 ETF
基金主代码	515710
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 24 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,205,599,785.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 1 月 7 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。
投资策略	本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。
业绩比较基准	中证细分食品饮料产业主题指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其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。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用组合复制策略，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。

### 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	华宝基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周雷
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、400-820-5050	95588
传真	021-38505777	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世	北京市西城区复兴门内大街 55

	纪大道 100 号上海环球金融中心 58 楼	号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	黄孔威	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	11,478,360.79
本期利润	-72,904,668.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0646
本期加权平均净值利润率	-8.21%
本期基金份额净值增长率	-9.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-351,732,022.39
期末可供分配基金份额利润	-0.2917
期末基金资产净值	853,867,762.61
期末基金份额净值	0.7083
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-29.17%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润等于本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4. 期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

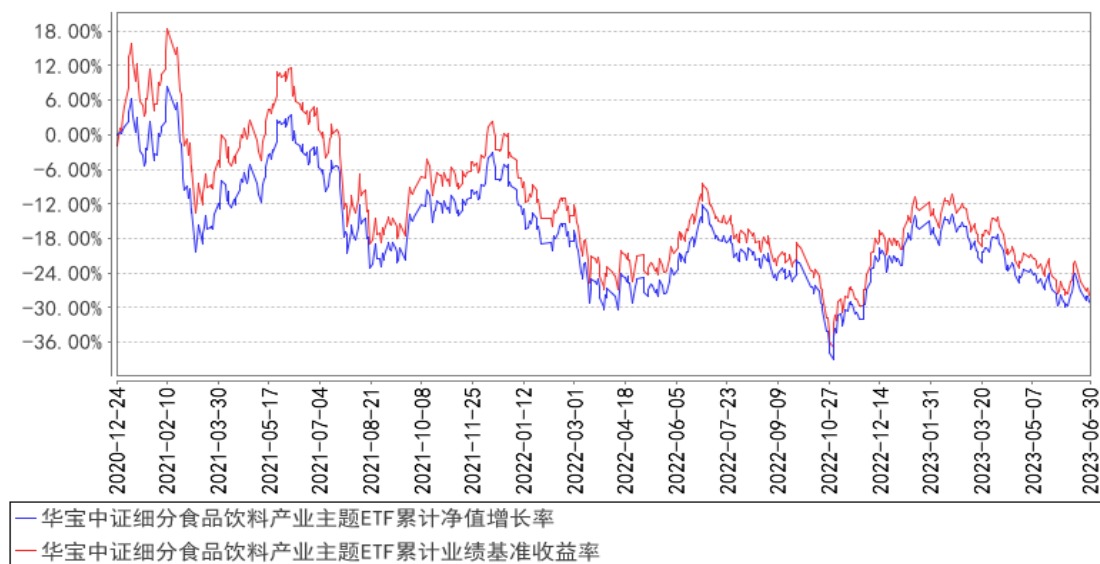
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.81%	1.41%	-0.69%	1.44%	1.50%	-0.03%
过去三个月	-13.91%	1.23%	-15.75%	1.25%	1.84%	-0.02%
过去六个月	-9.85%	1.31%	-11.70%	1.33%	1.85%	-0.02%
过去一年	-19.42%	1.53%	-21.49%	1.55%	2.07%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-29.17%	1.80%	-28.04%	1.86%	-1.13%	-0.06%

注：（1）基金业绩基准：中证细分食品饮料产业主题指数收益率；

（2）净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

#### 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

华宝中证细分食品饮料产业主题ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至2021年06月24日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

## § 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

华宝基金管理有限公司（公司原名“华宝兴业基金管理有限公司”）于 2003 年 2 月 12 日经中国证监会批准设立，2003 年 3 月 7 日在国家工商总局注册登记并正式开业，是国内首批中外合资基金管理公司。成立之初，公司注册资本为 1 亿元人民币，2007 年经中国证监会批准，公司注册资本增加至 1.5 亿元人民币。2017 年公司名称变更为“华宝基金管理有限公司”。目前公司股东为华宝信托有限责任公司、美国华平资产管理有限合伙（Warburg Pincus Asset Management, L.P.）和江苏省铁路集团有限公司，持有股权占比分别为 51%、29%、20%。公司在北京和深圳设有分公司，在香港设有子公司——华宝资产管理(香港)有限公司。截至本报告期末（2023 年 06 月 30 日），本公司正在管理运作的公开募集证券投资基金共 139 只。

#### 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		
蒋俊阳	本基金基金经理	2020-12-24	-	14 年	硕士。曾在上海申银万国证券研究所、光大证券研究所从事研究工作。2018 年 10 月加入华宝基金管理有限公司担任基金经理助理。2020 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2020 年 12 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 3 月至 2022 年 2 月任华宝中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 6 月起任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2021 年 7 月起任华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 7 月起任华宝中证电子 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 9 月起任华宝深证创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，2021 年 11 月起任华宝中证 800 地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。



2、证券从业含义遵从《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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有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

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 上半年，宏观经济整体呈现弱复苏状态，国民经济总体回升向好，高质量发展扎实推进，产业升级厚积薄发，但同时也面临新的困难挑战，主要是国内需求不足，外部环境复杂严峻等。全球来看，中美利差持续倒挂，全球进入去库存周期，但仍保持较强韧性。展望未来，预计国内宏观政策环境仍偏宽松，伴随国内稳增长政策的持续落地和消费者信心的逐步恢复，宏观经济有望继续复苏。市场方面，A 股整体呈现结构性行情，不同板块表现差异明显。2023 上半年，通信、

传媒、计算机等行业表现较好，商贸零售、房地产、建筑材料、农牧渔、食品饮料等行业表现较弱。本报告期内，以中证 100 指数和沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股指数分别下跌了 1.26%和 0.75%；而作为成长股代表的创业板指数下跌了 5.61%。在本报告期内，中证细分食品饮料产业主题指数累计下跌了 11.70%。

本报告期本基金为正常运作期，我们在操作中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-9.85%，业绩比较基准收益率为-11.70%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济与市场方面，7 月政治局会议强调“加大宏观政策调控力度”以及“着力扩大内需”等，展望 2023 下半年，预计“稳增长”仍然是国内经济政策的主要目标，宏观流动性也预计总体宽松。证券市场方面，目前市场整体向好，但波动在增加，结构性行情或将延续。

行业方面，政治局会议强调“扩大内需”是宏观政策的首要着力点，提出要发挥消费拉动经济增长的基础性作用。展望未来，在促消费政策的加持下，行业需求恢复叠加成本下行有望带来业绩弹性，我们对下半年食品饮料行业保持相对乐观态度。同时，食品饮料行业具有较高而稳定的 ROE 和盈利能力，行业竞争格局不断从分散走向集中，利好行业龙头。中证细分食品饮料产业主题指数聚焦白酒、啤酒、乳制品、调味品、食品综合等细分行业 50 家龙头公司，该指数紧跟沪深两市食品饮料行业龙头公司股票的整体表现。

作为指数基金的管理人，我们将继续严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对中证细分食品饮料产业主题指数的有效跟踪。

#### 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。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。参与估值的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值各方之间不存在重大利益冲突。

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公

司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

#### 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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期内，本基金的管理人——华宝基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华宝基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	18,019,884.84	16,517,072.64
结算备付金		185,763.82	321,074.12
存出保证金		64,083.35	61,493.33
交易性金融资产	6.4.7.2	839,033,278.92	958,775,793.45
其中：股票投资		839,033,278.92	958,775,793.45
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		6,936,338.55	607,333.31
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	77,608.45	3,698.39
资产总计		864,316,957.93	976,286,465.24
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		8,439,058.58	487,063.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		346,641.63	420,310.19
应付托管费		69,328.34	84,062.06
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		506.15	667.50
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,593,660.62	981,880.69
负债合计		10,449,195.32	1,973,983.82
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,205,599,785.00	1,240,099,785.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-351,732,022.39	-265,787,303.58
净资产合计		853,867,762.61	974,312,481.42
负债和净资产总计		864,316,957.93	976,286,465.24

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7083 元，基金份额总额 1,205,599,785.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-70,080,795.64	-16,876,048.36
1. 利息收入		239,496.97	438,908.47
其中：存款利息收入	6.4.7.13	29,906.84	43,545.92
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		209,590.13	395,362.55
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		13,827,150.82	-28,315,996.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	258,450.26	-41,949,388.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	13,568,700.56	13,633,391.41
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-

其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-84,383,028.81	10,189,216.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	235,585.38	811,823.82
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,823,872.38</b>	<b>3,435,825.99</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,209,700.50	2,704,617.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	441,940.08	540,923.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		754.60	1,423.38
8. 其他费用	6.4.7.23	171,477.20	188,862.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-72,904,668.02</b>	<b>-20,311,874.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-72,904,668.02</b>	<b>-20,311,874.35</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-72,904,668.02</b>	<b>-20,311,874.35</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,240,099,785.00	-	-265,787,303.58	974,312,481.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	1,240,099,785.	-	-265,787,303.5	974,312,481.42

资产(基金净值)	00		8	
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-34,500,000.00	-	-85,944,718.81	-120,444,718.81
(一)、综合收益总额	-	-	-72,904,668.02	-72,904,668.02
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-34,500,000.00	-	-13,040,050.79	-47,540,050.79
其中: 1. 基金申购款	412,500,000.00	-	-96,171,762.87	316,328,237.13
2. 基金赎回款	-447,000,000.00	-	83,131,712.08	-363,868,287.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,205,599,785.00	-	-351,732,022.39	853,867,762.61
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,271,599,785.00	-	-113,117,403.46	1,158,482,381.54
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,271,599,785.00	-	-113,117,403.46	1,158,482,381.54
三、本期增减变动	100,500,000.00	-	-52,915,214.61	47,584,785.39

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-20,311,874.35	-20,311,874.35
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	100,500,000.00	-	-32,603,340.26	67,896,659.74
其中: 1. 基金申购款	718,500,000.00	-	-159,555,577.50	558,944,422.50
2. 基金赎回款	-618,000,000.00	-	126,952,237.24	-491,047,762.76
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,372,099,785.00	-	-166,032,618.07	1,206,067,166.93

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:

向辉

基金管理人负责人

向辉

主管会计工作负责人

张幸骏

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金(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[2020]3245号《关于准予华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由华宝基金管理有限公司于2020年12月14日起至2020年12月18日止期间向社会公开募集,募集期结束



经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第 61471289\_B15 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 12 月 24 日生效。本基金为交易型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 865,098,660.00 元（含募集股票市值）；在募集期间产生利息为人民币 1,125.00 元。以上共募集资金总额为人民币 865,099,785.00 元，折合 865,099,785.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、股指期货、资产支持证券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）。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务和融资业务。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成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；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。

本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证细分食品饮料产业主题指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2023 年 8 月 29 日批准报出。

#### 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、应用指南、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颁布的《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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颁布的其他相关规定。

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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。

### （3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### （4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

### （5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	18,019,884.84
等于：本金	18,018,095.09
加：应计利息	1,789.75
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	18,019,884.84

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	960,556,973.54	-	839,033,278.92	-121,523,694.62
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	960,556,973.54	-	839,033,278.92	-121,523,694.62

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

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

### 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买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	1,992.21
待摊费用	75,616.24
合计	77,608.45

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6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	594,389.68
其中：交易所市场	594,389.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	136,697.44
应退替代款	862,573.50
合计	1,593,660.62

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,240,099,785.00	1,240,099,785.00

本期申购	412,500,000.00	412,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-447,000,000.00	-447,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,205,599,785.00	1,205,599,785.00

#### 6.4.7.11 其他综合收益

#### 6.4.7.12 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	-26,120,196.47	-239,667,107.11	-265,787,303.58
本期利润	11,478,360.79	-84,383,028.81	-72,904,668.02
本期基金份额交易产生的变动数	1,167,564.34	-14,207,615.13	-13,040,050.79
其中：基金申购款	-6,500,765.41	-89,670,997.46	-96,171,762.87
基金赎回款	7,668,329.75	75,463,382.33	83,131,712.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,474,271.34	-338,257,751.05	-351,732,022.39

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	25,742.45
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	3,604.28
其他	560.11
合计	29,906.84

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,003,393.61
股票投资收益——赎回差价收入	-5,744,943.35
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	258,450.26

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	204,451,086.11
减：卖出股票成本总额	197,856,572.23
减：交易费用	591,120.27
买卖股票差价收入	6,003,393.61

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	363,868,287.92
减：现金支付赎回款总额	156,760,902.92
减：赎回股票成本总额	212,852,328.35
减：交易费用	-
赎回差价收入	-5,744,943.35

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

#### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。



6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,568,700.56
其中：证券出借权益补偿收入	143,324.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,568,700.56

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-84,383,028.81
股票投资	-84,383,028.81
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-84,383,028.81

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	235,585.38
合计	235,585.38

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	396.00
IOPV 计算与发布费用	9,916.99
注册登记费用	74,383.76
合计	171,477.20

#### 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，本基金并无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内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
华宝基金管理有限公司(“华宝基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management. L.P.)	基金管理人的股东
江苏省铁路集团有限公司(“江苏铁集”)	基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司(“宝武集团”)	华宝信托的最终控制人
华宝证券股份有限公司(“华宝证券”)	受宝武集团控制的公司, 基金销售机构
华宝投资有限公司(“华宝投资”)	受宝武集团控制的公司
宝武集团财务有限责任公司(“宝武财务”)	受宝武集团控制的公司
华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(“华宝食品 ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

#### 6.4.10.1.4 权证交易

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,209,700.50	2,704,617.14
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	441,940.08	540,923.37

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华宝证券	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华宝证券	18,335,568.00	11,103.19	5,735,025.00	2,405.51

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与关联方通过约定申报方式进行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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
中国工商银行股份有限公司—华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	61,880,000.00	5.13	68,320,000.00	5.51

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	18,019,884.84	25,742.45	22,561,662.12	33,297.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,082	12,854.16	22,743.64	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

		日									
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-	
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-	
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-	
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-	
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-	
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-	
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-	
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-	
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股锁定	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-	
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-	
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-	
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-	
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	1,733	53,463.05	40,950.79	-	
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-	
301261	恒工	2023年	1个月	新股流	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-	

	精密	6月29日	内(含)	通受限							
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00		-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股锁定	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10		-
301281	科源制药	2023年5月26日	4个月	新股锁定-送股	-	25.10	96	-	2,409.60		-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股锁定	38.13	31.03	891	33,973.83	27,647.73		-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17		-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59		-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86		-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56		-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57		-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股锁定	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82		-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87		-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12		-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98		-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04		-

301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023年5月25日	3个月	新股锁定-送股	-	53.24	130	-	6,921.20	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股锁定	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	1,183	28,119.91	50,738.87	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-



		日									
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新股流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68		-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股锁定	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40		-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股锁定	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08		-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	2,433	16,009.14	18,442.14		-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	858	8,888.88	10,158.72		-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64		-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80		-
603135	中重	2023年	6个月	新股锁	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92		-

	科技	3月29日		定							
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51		-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86		-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	716	25,883.40	27,301.08		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	4,319	85,775.34	78,001.14		-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48		-
688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	2,279	27,575.90	27,507.53		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	754	17,794.40	48,761.18		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00		-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股锁定	37.88	29.49	1,318	49,925.84	38,867.82		-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96		-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	8,487	48,291.03	45,914.67		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	2,873	31,890.30	48,955.92		-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74		-

688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	新股锁定	39.99	36.71	724	28,952.76	26,578.04	-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定	245.56	122.11	126	30,940.56	15,385.86	-
688507	索辰科技	2023年6月20日	3个月	新股锁定-送股	-	122.11	60	-	7,326.60	-
688512	慧智微	2023年5月8日	6个月	新股锁定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股锁定	152.38	135.97	248	37,790.24	33,720.56	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	811	24,540.86	20,542.63	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-

		日								
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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

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

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

#### 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股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000729	燕京啤酒	2023年7月27日	12.47	12,000	149,640.00
2	000799	酒鬼酒	2023年7月12日-2023年7月14日	90.15	22,700	2,046,405.00
3	000860	顺鑫农业	2023年7月10日-2023年7月12日	33.69	45,600	1,536,264.00
4	002304	洋河股份	2023年7月13日	131.35	1,600	210,160.00
5	600132	重庆啤酒	2023年7月12日	92.16	10,300	949,248.00
6	600559	老白干酒	2023年7月12日-2023年7月14日	24.51	73,000	1,789,230.00
7	600872	中炬高新	2023年7月11日	36.79	27,500	1,011,725.00
8	603198	迎驾贡酒	2023年7月10日	63.80	18,000	1,148,400.00
合计	-	-	-	-	210,700	8,841,072.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告‘本基金持有的流通受限证券’部分内容。

### 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

本基金为 ETF 基金，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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括内部控制委员会、督察长、合规审计部、风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。内部控制委员会负责对公司在经营管理和基金运作中的风险进行评估并研究制订相应的控制制度。督察长向董事会负责，总管公司的内控事务并独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。风险管

理部在督察长指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；合规审计部在督察长的领导下对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为风险管理部和合规审计部对各岗位、各部门、各项业务全面实施监督反馈；最后是以内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对风险管理部和合规审计部的工作予以直接指导。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，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的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例较低（含债券投资比例为零），因此无重大信用风险（上年度末：同）。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

### 6.4.13.3 流动性风险

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

于本报告期末，本基金所承担的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（所有者权益）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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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。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。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,019,884.84	-	-	-	18,019,884.84
结算备付金	185,763.82	-	-	-	185,763.82
存出保证金	64,083.35	-	-	-	64,083.35
交易性金融资产	-	-	-	839,033,278.92	839,033,278.92
应收清算款	-	-	-	6,936,338.55	6,936,338.55
其他资产	-	-	-	77,608.45	77,608.45



资产总计	18,269,732.01	-	-	-846,047,225.92	864,316,957.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	346,641.63	346,641.63
应付托管费	-	-	-	69,328.34	69,328.34
应付清算款	-	-	-	8,439,058.58	8,439,058.58
应交税费	-	-	-	506.15	506.15
其他负债	-	-	-	1,593,660.62	1,593,660.62
负债总计	-	-	-	10,449,195.32	10,449,195.32
利率敏感度缺口	18,269,732.01	-	-	-835,598,030.60	853,867,762.61
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,517,072.64	-	-	-	16,517,072.64
结算备付金	321,074.12	-	-	-	321,074.12
存出保证金	61,493.33	-	-	-	61,493.33
交易性金融资产	-	-	-	-958,775,793.45	958,775,793.45
应收清算款	-	-	-	607,333.31	607,333.31
其他资产	-	-	-	3,698.39	3,698.39
资产总计	16,899,640.09	-	-	-959,386,825.15	976,286,465.24
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	420,310.19	420,310.19
应付托管费	-	-	-	84,062.06	84,062.06
应付清算款	-	-	-	487,063.38	487,063.38
应交税费	-	-	-	667.50	667.50
其他负债	-	-	-	981,880.69	981,880.69
负债总计	-	-	-	1,973,983.82	1,973,983.82
利率敏感度缺口	16,899,640.09	-	-	-957,412,841.33	974,312,481.42

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

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资(上年度末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证细分食品饮料产业主题指数的方法为原则，根据标的指数成份股票在指数中的权重确定成份股票的买卖数量，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在因特殊情况（如成份股停牌、流动性不足、法规法律限制等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股、备选成份股等进行替代，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。 本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证细分食品饮料产业主题指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量于国内依法发行上市的非成份股、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	839,033,278.92	98.26	958,775,793.45	98.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	839,033,278.92	98.26	958,775,793.45	98.41

#### 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	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	41,929,803.14	47,880,903.12
	2. 业绩比较基准下降 5%	-41,929,803.14	-47,880,903.12

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	836,763,342.44	957,154,593.11
第二层次	761,290.14	-
第三层次	1,508,646.34	1,621,200.34
合计	839,033,278.92	958,775,793.45

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券等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，确定相关证券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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	839,033,278.92	97.07
	其中：股票	839,033,278.92	97.07
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	18,205,648.66	2.11
8	其他各项资产	7,078,030.35	0.82
9	合计	864,316,957.93	100.00

注：1、此处股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值，两者在金额上可能不相等。

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 8,841,072.00 元，占基金资产净值的比例为 1.04%。

3、本基金本报告期末“固定收益投资”、“买入返售金融资产”、“银行存款和结算备付金合计”等项目的列报金额已包含对应的“应计利息”和“减值准备”（若有），“其他资产”中的“应收利息”指本基金截至本报告期末已过付息期但尚未收到的利息金额（下同）。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	836,763,342.44	98.00

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	836,763,342.44	98.00

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,004,247.21	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	50,639.98	0.01
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	108,341.76	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,269,936.48	0.27

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	77,200	130,545,200.00	15.29
2	000858	五粮液	775,965	126,924,595.05	14.86
3	600887	伊利股份	3,330,842	94,329,445.44	11.05
4	000568	泸州老窖	388,441	81,405,580.37	9.53
5	600809	山西汾酒	250,120	46,289,708.40	5.42
6	002304	洋河股份	309,740	40,684,349.00	4.76
7	603288	海天味业	856,938	40,147,545.30	4.70
8	000596	古井贡酒	85,800	21,225,204.00	2.49
9	600600	青岛啤酒	181,336	18,791,849.68	2.20
10	603369	今世缘	321,900	16,996,320.00	1.99
11	600702	舍得酒业	118,438	14,680,390.10	1.72
12	300146	汤臣倍健	524,456	12,576,454.88	1.47
13	600872	中炬高新	323,053	11,885,119.87	1.39
14	600132	重庆啤酒	125,322	11,549,675.52	1.35
15	600298	安琪酵母	311,994	11,297,302.74	1.32
16	000799	酒鬼酒	116,874	10,536,191.10	1.23
17	002568	百润股份	268,628	9,764,627.80	1.14
18	600873	梅花生物	1,059,357	9,460,058.01	1.11
19	000729	燕京啤酒	741,300	9,244,011.00	1.08
20	600559	老白干酒	376,400	9,225,564.00	1.08
21	603589	口子窖	184,400	9,100,140.00	1.07
22	000860	顺鑫农业	267,202	9,002,035.38	1.05
23	603198	迎驾贡酒	124,296	7,930,084.80	0.93

24	002507	涪陵榨菜	413,998	7,580,303.38	0.89
25	603027	千禾味业	298,084	6,295,534.08	0.74
26	600779	水井坊	99,600	5,875,404.00	0.69
27	603866	桃李面包	409,796	4,147,135.52	0.49
28	002597	金禾实业	172,400	4,068,640.00	0.48
29	600197	伊力特	145,100	3,942,367.00	0.46
30	605499	东鹏饮料	21,900	3,786,510.00	0.44
31	600597	光明乳业	355,332	3,695,452.80	0.43
32	002216	三全食品	226,080	3,522,326.40	0.41
33	603043	广州酒家	116,960	3,305,289.60	0.39
34	002847	盐津铺子	38,350	3,261,667.50	0.38
35	600305	恒顺醋业	286,740	3,113,996.40	0.36
36	600882	妙可蓝多	132,700	2,956,556.00	0.35
37	002626	金达威	156,900	2,948,151.00	0.35
38	000848	承德露露	322,400	2,853,240.00	0.33
39	300973	立高食品	36,200	2,476,804.00	0.29
40	603919	金徽酒	104,600	2,456,008.00	0.29
41	600929	雪天盐业	302,900	2,405,026.00	0.28
42	603317	天味食品	163,912	2,394,754.32	0.28
43	300765	新诺威	178,900	2,306,021.00	0.27
44	000869	张裕 A	70,100	2,149,266.00	0.25
45	002461	珠江啤酒	227,600	2,005,156.00	0.23
46	002053	云南能投	141,600	1,588,752.00	0.19
47	001338	永顺泰	76,900	1,418,036.00	0.17
48	002946	新乳业	88,700	1,272,845.00	0.15
49	603235	天新药业	26,400	827,904.00	0.10
50	603170	宝立食品	24,400	518,744.00	0.06

### 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	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
2	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
3	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
4	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
5	688249	晶合集成	4,319	78,001.14	0.01
6	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
7	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
8	301358	湖南裕能	1,183	50,738.87	0.01
9	688472	阿特斯	2,873	48,955.92	0.01
10	688361	中科飞测	754	48,761.18	0.01
11	688469	中芯集成	8,487	45,914.67	0.01
12	301260	格力博	1,733	40,950.79	0.00
13	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00

14	688443	智翔金泰	1,318	38,867.82	0.00
15	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
16	688531	日联科技	248	33,720.56	0.00
17	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
18	301291	明阳电气	891	27,647.73	0.00
19	688352	颀中科技	2,279	27,507.53	0.00
20	688146	中船特气	716	27,301.08	0.00
21	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
22	688484	南芯科技	724	26,578.04	0.00
23	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
24	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
25	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
26	001287	中电港	1,082	22,743.64	0.00
27	688507	索辰科技	186	22,712.46	0.00
28	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
29	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
30	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
31	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
32	688570	天玛智控	811	20,542.63	0.00
33	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
34	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
35	601061	中信金属	2,433	18,442.14	0.00
36	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
37	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
38	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
39	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
40	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
41	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
42	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
43	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
44	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
45	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
46	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
47	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
48	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
49	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
50	301210	金杨股份	281	13,816.77	0.00
51	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
52	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
53	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
54	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
55	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
56	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00



57	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
58	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
59	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
60	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
61	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
62	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
63	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
64	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
65	601065	江盐集团	858	10,158.72	0.00
66	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
67	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
68	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
69	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
70	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
71	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
72	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
73	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
74	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
75	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
76	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
77	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
78	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
79	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
80	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
81	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
82	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
83	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
84	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
85	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
86	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
87	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
88	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
89	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
90	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
91	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
92	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	53,543,390.00	5.50
2	000568	泸州老窖	36,803,708.82	3.78

3	002304	洋河股份	18,129,045.15	1.86
4	000596	古井贡酒	8,490,240.00	0.87
5	300146	汤臣倍健	4,216,889.00	0.43
6	600519	贵州茅台	4,203,440.00	0.43
7	002568	百润股份	4,123,366.00	0.42
8	000729	燕京啤酒	3,647,288.00	0.37
9	600887	伊利股份	3,576,868.00	0.37
10	000799	酒鬼酒	3,384,475.00	0.35
11	300973	立高食品	3,101,963.00	0.32
12	000848	承德露露	3,011,928.00	0.31
13	002507	涪陵榨菜	2,944,948.20	0.30
14	000860	顺鑫农业	2,901,201.00	0.30
15	300765	新诺威	2,388,253.00	0.25
16	600809	山西汾酒	1,923,016.00	0.20
17	603288	海天味业	1,818,204.20	0.19
18	600298	安琪酵母	1,755,206.00	0.18
19	002597	金禾实业	1,617,185.00	0.17
20	002053	云南能投	1,590,057.00	0.16

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 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	000858	五粮液	63,972,399.92	6.57
2	000568	泸州老窖	36,245,712.62	3.72
3	002304	洋河股份	19,883,127.10	2.04
4	000596	古井贡酒	8,368,304.00	0.86
5	600519	贵州茅台	7,933,890.00	0.81
6	603156	养元饮品	5,811,096.64	0.60
7	002568	百润股份	4,327,607.40	0.44
8	300146	汤臣倍健	4,163,701.00	0.43
9	000799	酒鬼酒	4,075,403.96	0.42
10	000729	燕京啤酒	3,465,035.00	0.36
11	002507	涪陵榨菜	3,067,371.00	0.31
12	000860	顺鑫农业	2,861,557.22	0.29
13	300973	立高食品	2,849,690.00	0.29
14	002481	双塔食品	2,376,210.00	0.24
15	002597	金禾实业	1,838,472.14	0.19
16	301206	三元生物	1,703,433.00	0.17
17	600702	舍得酒业	1,566,893.00	0.16
18	002216	三全食品	1,476,909.22	0.15
19	002626	金达威	1,350,806.78	0.14
20	600882	妙可蓝多	1,072,357.27	0.11

注：卖出金额不包括相关交易费用。

### 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	195,958,589.46
卖出股票收入（成交）总额	204,451,086.11

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

### 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投资。

### 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投资。

### 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

本基金未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

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

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	64,083.35
2	应收清算款	6,936,338.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,992.21
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	7,078,030.35

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002304	洋河股份	210,160.00	0.02	转融通流通受限

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301486	致尚科技	277,921.20	0.03	新股流通受限
2	301395	仁信新材	138,629.28	0.02	新股流通受限
3	301292	海科新源	116,421.76	0.01	新股流通受限
4	301202	朗威股份	79,009.20	0.01	新股流通受限
5	688249	晶合集成	78,001.14	0.01	新股锁定

### 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，合计数可能不等于分项之和。

## § 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

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
37,303	32,319.11	269,783,539.00	22.38	935,816,246.00	77.62

### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国工商银行股份有限公司—华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	61,880,000.00	5.13

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	华泰证券股份有限公司融券专用证券账户	40,500,000.00	3.36
2	北京鑫通顺达汽车租赁有限公司	25,000,000.00	2.07
3	中国国际金融股份有限公司	17,456,593.00	1.45
4	天瓴(北京)投资管理有限公司—天瓴21号大类资产配置私募证券投资基金	16,600,000.00	1.38
5	海通证券股份有限公司	16,351,401.00	1.36
6	东方财富证券股份有限公司	13,605,100.00	1.13
7	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	12,196,900.00	1.01
8	太平养老金溢优2号混合型养老金产品—上海浦东发展银行股份有限公司	7,321,300.00	0.61
9	方正证券股份有限公司	6,264,342.00	0.52
10	郑云波	5,585,700.00	0.46
11	中国工商银行股份有限公司—华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	61,880,000.00	5.13

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	9,500.00	0.0008

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年12月24日） 基金份额总额	865,099,785.00
本报告期期初基金份额总额	1,240,099,785.00
本报告期基金总申购份额	412,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	447,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,205,599,785.00

## § 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

#### 1、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日起至本报告期末。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	1	102,818,199.32	26.82	94,726.37	26.78	-
中信证券	2	88,297,017.05	23.03	81,348.05	23.00	-
广发证券	2	66,036,808.77	17.23	61,240.66	17.31	-
长江证券	1	65,302,637.66	17.04	60,163.22	17.01	-
华创证券	1	15,934,824.11	4.16	14,680.79	4.15	-
华金证券	2	15,884,669.25	4.14	14,714.78	4.16	-
国泰君安	2	7,352,570.96	1.92	6,773.90	1.91	-
申万宏源	1	7,105,182.90	1.85	6,616.98	1.87	-
南京证券	1	6,230,230.14	1.63	5,739.99	1.62	-
国金证券	2	4,142,526.71	1.08	3,816.51	1.08	-
海通证券	1	2,444,091.22	0.64	2,276.25	0.64	-
东方财富	2	1,379,794.51	0.36	1,284.99	0.36	-
安信证券	2	398,268.20	0.10	366.94	0.10	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
星展证券	2	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准： 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；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，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2. 本期交易单元未发生变化。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 第 4 季度报告	基金管理人网站	2023-01-19
2	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增东方证券股份有限公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-02-01
3	华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 年度报告	基金管理人网站	2023-03-31
4	华宝基金管理有限公司旗下部分基金 季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-04-22
5	华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 第 1 季度报告	基金管理人网站	2023-04-23
6	华宝基金关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金新增华福证券有限责任公司为一级交易商的公告	基金管理人网站, 上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2023-05-31

## § 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。



## 11.2 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

中国证监会批准基金设立的文件；  
华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同；  
华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；  
华宝中证细分食品饮料产业主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议；  
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；  
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；  
基金托管人业务资格批件和营业执照。

#### 12.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

#### 12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝基金管理有限公司

2023年8月31日