

# 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

## 2025 年中期报告

2025 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:2025 年 08 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025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2025年01月01日起至2025年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§1</b>	<b>重要提示及目录</b>	2
<b>1.1</b>	<b>重要提示</b>	2
<b>1.2</b>	<b>目录</b>	3
<b>§2</b>	<b>基金简介</b>	5
<b>2.1</b>	<b>基金基本情况</b>	5
<b>2.2</b>	<b>基金产品说明</b>	5
<b>2.3</b>	<b>基金管理人和基金托管人</b>	7
<b>2.4</b>	<b>信息披露方式</b>	7
<b>2.5</b>	<b>其他相关资料</b>	8
<b>§3</b>	<b>主要财务指标和基金净值表现</b>	8
<b>3.1</b>	<b>主要会计数据和财务指标</b>	8
<b>3.2</b>	<b>基金净值表现</b>	9
<b>§4</b>	<b>管理人报告</b>	11
<b>4.1</b>	<b>基金管理人及基金经理情况</b>	11
<b>4.2</b>	<b>管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明</b>	12
<b>4.3</b>	<b>管理人对报告期内公平交易情况的专项说明</b>	12
<b>4.4</b>	<b>管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明</b>	12
<b>4.5</b>	<b>管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望</b>	13
<b>4.6</b>	<b>管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明</b>	13
<b>4.7</b>	<b>管理人对报告期内基金利润分配情况的说明</b>	14
<b>4.8</b>	<b>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</b>	14
<b>§5</b>	<b>托管人报告</b>	14
<b>5.1</b>	<b>报告期内本基金托管人遵规守信情况声明</b>	14
<b>5.2</b>	<b>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</b>	14
<b>5.3</b>	<b>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</b>	15
<b>§6</b>	<b>半年度财务会计报告（未经审计）</b>	15
<b>6.1</b>	<b>资产负债表</b>	15
<b>6.2</b>	<b>利润表</b>	17
<b>6.3</b>	<b>净资产变动表</b>	18
<b>6.4</b>	<b>报表附注</b>	20
<b>§7</b>	<b>投资组合报告</b>	50
<b>7.1</b>	<b>期末基金资产组合情况</b>	50
<b>7.2</b>	<b>报告期末按行业分类的股票投资组合</b>	51
<b>7.3</b>	<b>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</b>	52
<b>7.4</b>	<b>报告期内股票投资组合的重大变动</b>	56
<b>7.5</b>	<b>期末按债券品种分类的债券投资组合</b>	58
<b>7.6</b>	<b>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</b>	59
<b>7.7</b>	<b>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</b>	59
<b>7.8</b>	<b>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</b>	59
<b>7.9</b>	<b>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</b>	59
<b>7.10</b>	<b>期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细</b>	59
<b>7.11</b>	<b>本基金投资股指期货的投资政策</b>	60
<b>7.12</b>	<b>报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明</b>	60
<b>7.13</b>	<b>投资组合报告附注</b>	60
<b>§8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	61
<b>8.1</b>	<b>期末基金份额持有人户数及持有人结构</b>	61

---

<b>8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况</b>	61
<b>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</b>	62
<b>§9 开放式基金份额变动</b>	62
<b>§10 重大事件揭示</b>	63
<b>10.1 基金份额持有人大会决议</b>	63
<b>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</b>	63
<b>10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼</b>	63
<b>10.4 基金投资策略的改变</b>	63
<b>10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况</b>	63
<b>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</b>	63
<b>10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况</b>	63
<b>10.8 其他重大事件</b>	65
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b>	66
<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</b>	66
<b>11.2 影响投资者决策的其他重要信息</b>	66
<b>§12 备查文件目录</b>	66
<b>12.1 备查文件目录</b>	66
<b>12.2 存放地点</b>	66
<b>12.3 查阅方式</b>	66

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	天弘中证食品饮料ETF联接	
基金主代码	001631	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年07月29日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,285,520,544.01份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证食品饮料ET F联接A	天弘中证食品饮料ET F联接C
下属分级基金的交易代码	001631	001632
报告期末下属分级基金的份额总额	451,677,940.20份	1,833,842,603.81份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金	
基金主代码	159736	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2021年09月09日	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2021年09月27日	
基金管理人名称	天弘基金管理有限公司	
基金托管人名称	中信证券股份有限公司	

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.2.1 目标基金产品说明

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

	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	童建林	杨军智
联系电话	022-83310208	010-60834299
电子邮箱	service@thfund.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话	95046	010-60836588
传真	022-83865564	010-60834004
注册地址	天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码	300203	100125
法定代表人	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	中国证券报
登载基金中期报告正	www.thfund.com.cn

文的管理人互联网网址	
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 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 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	天弘中证食品饮料 ETF联接A	天弘中证食品饮料 ETF联接C
本期已实现收益	-22,010,623.57	-90,608,531.90
本期利润	-48,262,286.20	-189,590,376.27
加权平均基金份额本期利润	-0.1048	-0.1019
本期加权平均净值利润率	-4.72%	-4.69%
本期基金份额净值增长率	-4.59%	-4.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	495,966,142.65	1,920,193,843.95
期末可供分配利润	1.0981	1.0471
期末可供分配基金份额利润	978,670,908.13	3,891,113,119.90
期末基金资产净值	2.1667	2.1218
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	128.13%	123.41%
基金份额累计净值增长率		

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

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘中证食品饮料ETF联接A

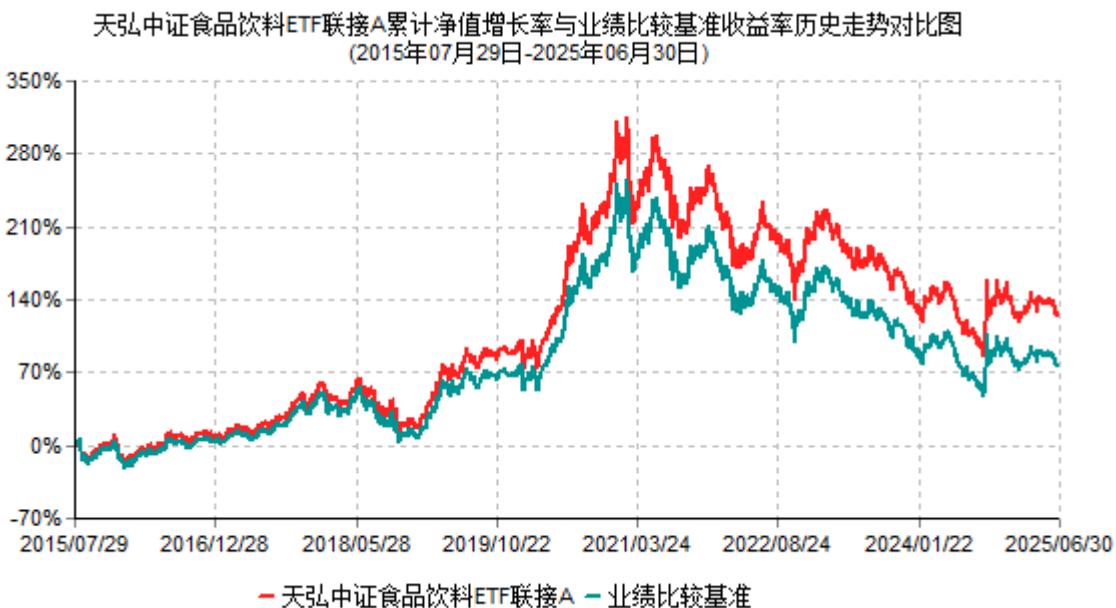
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.78%	0.73%	-4.98%	0.75%	1.20%	-0.02%
过去三个月	-3.29%	0.99%	-4.61%	1.00%	1.32%	-0.01%
过去六个月	-4.59%	1.08%	-6.31%	1.08%	1.72%	0.00%
过去一年	5.49%	1.68%	2.18%	1.68%	3.31%	0.00%
过去三年	-31.68%	1.43%	-36.20%	1.43%	4.52%	0.00%
自基金合同生效日起至今	128.13%	1.56%	77.60%	1.58%	50.53%	-0.02%

天弘中证食品饮料ETF联接C

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	-3.80%	0.73%	-4.98%	0.75%	1.18%	-0.02%
过去三个月	-3.33%	0.99%	-4.61%	1.00%	1.28%	-0.01%
过去六个月	-4.69%	1.08%	-6.31%	1.08%	1.62%	0.00%
过去一年	5.28%	1.68%	2.18%	1.68%	3.10%	0.00%
过去三年	-32.09%	1.43%	-36.20%	1.43%	4.11%	0.00%

自基金合同生效日起至今	123.41%	1.56%	77.60%	1.58%	45.81%	-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2015年07月29日生效。  
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

## §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2025年06月30日，公司共管理运作223只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沙川	本基金基金经理	2021年11月	-	14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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为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2025年上半年按照基金合同约定将基金资产投资于对应的ETF份额和基准指数成分股，成分股投资采用完全复制的投资策略来控制跟踪误差，并力争在跟踪误差允许范围内获取更多收益。

期间基金整体运行平稳，日均跟踪偏离和年化跟踪误差均控制在合理范围内。日均跟踪偏离和跟踪误差主要来自基金每日的申购赎回导致的基金仓位变化、指数成分股调整导致的结构偏离、指数成分股分红以及持有的新股上市后涨幅与基准指数涨幅的差异。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年06月30日，天弘中证食品饮料ETF联接A基金份额净值为2.1667元，天弘中证食品饮料ETF联接C基金份额净值为2.1218元。报告期内份额净值增长率天弘中证食品饮料ETF联接A为-4.59%，同期业绩比较基准增长率为-6.31%；天弘中证食品饮料ETF联接C为-4.69%，同期业绩比较基准增长率为-6.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从海外经济来看，下半年全球经济复苏的压力增大，同时美国通胀预期仍存，美元继续走弱，经济不确定性在于关税谈判的情况、美联储何时重启降息以及地缘政治风险。对2026年的经济预测，IMF认为海外主要经济体实际GDP增速将较2025年上升。

国内的宏观环境，出口由于关税不确定性，预计6、7月“抢出口”、“抢转口”对我国出口还有支撑，但由于关税压力下全球制造业周期走弱，预计三季度中后段开始一直到明年初，出口可能会有一定压力。但当前关税并未实质性损害我国出口竞争力，明年年中左右我国出口可能跟随全球经济周期、外需的修复而企稳回升。消费方向，下半年1380亿国补资金陆续到位，支撑消费。投资：地产景气仍在下滑，需要政策呵护。新增专项债剔除其他用途后，用于基建的金额相比2024年总体平稳。制造业方向，今年以来政策反复提及反内卷，我们认为反内卷是A股制造业改革的中长期主线，重点关注各个行业具体方案落地情况。

综合来看，当前的宏观环境处于稳步修复，同时有增量政策托底的阶段，对资本市场形成较为温和的投资环境。与此同时，资金面保持适度宽松，股票市场微观流动性比较充裕，股市成交活跃，流动性环境整体利好股票市场。整体上，我们对股票市场的观点偏积极，成长和价值板块均有表现机会。

食品饮料板块受基建项目推出和开发的影响，短期情绪修复具有阶段性机会。但中长期表现还是依赖于大的经济环境的好转以及由此带来的基本面的修复，这一点尚有待观察。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，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联接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联接基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	257,685,847.33	222,025,470.44
结算备付金		-	804,422.89
存出保证金		258,196.64	429,224.49
交易性金融资产	6.4.7.2	4,621,350,027.80	5,063,992,757.20
其中：股票投资		192,970,090.67	179,217,921.05
基金投资		4,407,193,583.85	4,816,268,395.50
债券投资		21,186,353.28	68,506,440.65
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	-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		14,570,164.57	17,630,523.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,893,864,236.34	5,304,882,398.78
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b> 2025年06月30日	<b>上年度末</b> 2024年12月31日
<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		4,810,725.23	5,317,858.38
应付赎回款		18,282,912.90	20,530,433.25
应付管理人报酬		181,084.32	191,817.19
应付托管费		36,216.88	38,363.43
应付销售服务费		642,958.44	721,845.13
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	126,310.54	216,209.35
负债合计		24,080,208.31	27,016,526.73
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.7	2,285,520,544.01	2,361,448,328.21
未分配利润	6.4.7.8	2,584,263,484.02	2,916,417,543.84
净资产合计		4,869,784,028.03	5,277,865,872.05
负债和净资产总计		4,893,864,236.34	5,304,882,398.78

注：报告截止日2025年06月30日，天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额净值2.1667元，天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金

基金联接基金C类基金份额净值2.1218元；基金份额总额2,285,520,544.01份，其中天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额451,677,940.20份，天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额1,833,842,603.81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联接基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
<b>一、营业收入</b>		-232,427,641.55	-705,343,574.00
1.利息收入		1,733,312.40	2,234,296.91
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,733,312.40	2,234,296.91
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）		-109,212,182.00	-85,033,812.60
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,994,516.70	-22,236,709.33
基金投资收益	6.4.7.11	-107,995,632.99	-65,460,541.40
债券投资收益	6.4.7.12	115,078.97	81,233.34
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,662,888.72	2,582,204.79
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-125,233,507.00	-622,684,848.26
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	284,735.05	140,789.95
<b>减: 二、营业总支出</b>		5,425,020.92	5,564,908.74
1.管理人报酬		1,090,869.46	1,100,882.15
2.托管费		218,173.96	220,176.48
3.销售服务费		4,007,798.55	4,121,505.42
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	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	0.01
8.其他费用	6.4.7.20	108,178.95	122,344.68
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-237,852,662.47	-710,908,482.74
<b>减: 所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-237,852,662.47	-710,908,482.74
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-237,852,662.47	-710,908,482.74

### 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联接基金

本报告期: 2025年01月01日至2025年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期
	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	2,361,448,328.21	2,916,417,543.84	5,277,865,872.05
二、本期期初净资产	2,361,448,328.21	2,916,417,543.84	5,277,865,872.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-75,927,784.20	-332,154,059.82	-408,081,844.02
(一)、综合收益总额	-	-237,852,662.47	-237,852,662.47
(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）	-75,927,784.20	-94,301,397.35	-170,229,181.55
其中：1.基金申购款	836,945,988.25	986,548,825.82	1,823,494,814.07
2.基金赎回款	-912,873,772.45	-1,080,850,223.17	-1,993,723,995.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,285,520,544.01	2,584,263,484.02	4,869,784,028.03
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	2,378,927,206.71	3,155,661,509.09	5,534,588,715.80
二、本期期初净资产	2,378,927,206.71	3,155,661,509.09	5,534,588,715.80
三、本期增减变动	-28,395,076.28	-750,594,082.72	-778,989,159.00

额（减少以“-”号填列）			
(一)、综合收益总额	-	-710,908,482.74	-710,908,482.74
(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）	-28,395,076.28	-39,685,599.98	-68,080,676.26
其中：1.基金申购款	561,634,728.32	689,094,714.98	1,250,729,443.30
2.基金赎回款	-590,029,804.60	-728,780,314.96	-1,318,810,119.56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,350,532,130.43	2,405,067,426.37	4,755,599,556.80

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

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）由天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金转型而来，天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资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[2015]1392号《关于准予天弘中证食品饮料指数型发起式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2015年07月29日生效，首次设立募集规模为10,000,000.00份基金份额。本基金的运作方式为契约

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。

根据基金管理人于2021年11月04日发布的《关于天弘中证食品饮料指类型发起式证券投资基金变更为天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订基金合同的公告》，原天弘中证食品饮料指类型发起式证券投资基金于2021年11月04日变更为天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以目标ETF基金份额、中证食品饮料指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

#### 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颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金管理业务的指导意见》、《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

本基金2025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2025年06月30日的财务状况以及2025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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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》、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》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)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、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。

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

d)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)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资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 2025年06月30日
活期存款	257,685,847.33
等于：本金	257,587,883.98
加：应计利息	97,963.35
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	257,685,847.33

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	208,757,356.00	-	192,970,090.67	-15,787,265.33
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	20,981,804.00	190,203.28	21,186,353.28
	银行间市场	-	-	-
	合计	20,981,804.00	190,203.28	21,186,353.28
资产支持证券	-	-	-	-
基金	6,300,859,506.83	-	4,407,193,583.85	-1,893,665,922.98
其他	-	-	-	-
合计	6,530,598,666.83	190,203.28	4,621,350,027.80	-1,909,438,842.31

#### 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

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,523.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	21,107.72
其中：交易所市场	21,107.72
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	103,678.95
合计	126,310.54

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 天弘中证食品饮料ETF联接A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证食品饮料ETF联接 A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	469,099,045.72	469,099,045.72
本期申购	76,849,153.28	76,849,153.28
本期赎回(以“-”号填列)	-94,270,258.80	-94,270,258.80
本期末	451,677,940.20	451,677,940.20

#### 6.4.7.7.2 天弘中证食品饮料ETF联接C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证食品饮料ETF联接 C)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,892,349,282.49	1,892,349,282.49
本期申购	760,096,834.97	760,096,834.97

本期赎回(以“-”号填列)	-818,603,513.65	-818,603,513.65
本期末	1,833,842,603.81	1,833,842,603.81

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 天弘中证食品饮料ETF联接A

单位：人民币元

项目 (天弘中证食品饮料ET F联接A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	537,556,376.70	58,649,965.85	596,206,342.55
本期期初	537,556,376.70	58,649,965.85	596,206,342.55
本期利润	-22,010,623.57	-26,251,662.63	-48,262,286.20
本期基金份额交易产 生的变动数	-19,579,610.48	-1,371,477.94	-20,951,088.42
其中：基金申购款	86,428,404.10	7,275,365.66	93,703,769.76
基金赎回款	-106,008,014.58	-8,646,843.60	-114,654,858.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	495,966,142.65	31,026,825.28	526,992,967.93

##### 6.4.7.8.2 天弘中证食品饮料ETF联接C

单位：人民币元

项目 (天弘中证食品饮料ET F联接C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,074,303,616.67	245,907,584.62	2,320,211,201.29
本期期初	2,074,303,616.67	245,907,584.62	2,320,211,201.29
本期利润	-90,608,531.90	-98,981,844.37	-189,590,376.27
本期基金份额交易产 生的变动数	-63,501,240.82	-9,849,068.11	-73,350,308.93
其中：基金申购款	815,923,743.58	76,921,312.48	892,845,056.06
基金赎回款	-879,424,984.40	-86,770,380.59	-966,195,364.99

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,920,193,843.95	137,076,672.14	2,057,270,516.09

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	1,731,036.18
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	665.01
其他	1,611.21
合计	1,733,312.40

#### 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 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,994,516.70
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-4,994,516.70

##### 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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	143,763,805.01
减：卖出股票成本总额	148,616,463.32
减：交易费用	141,858.39

买卖股票差价收入	-4,994,516.70
----------	---------------

#### 6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	285,913,435.90
减：卖出/赎回基金成本总额	393,898,239.01
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	10,829.88
基金投资收益	-107,995,632.99

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	295,737.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-180,658.20
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	115,078.97

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	62,011,899.38
减：卖出债券（债	61,211,179.00

转股及债券到期兑付)成本总额	
减: 应计利息总额	981,378.58
减: 交易费用	-
买卖债券差价收入	-180,658.20

#### 6.4.7.13 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。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 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。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,662,888.72
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	3,662,888.72

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	-125,233,507.00

——股票投资	-4,717,985.96
——债券投资	120,045.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-120,635,566.04
——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	-125,233,507.00

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	267,991.06
基金转换费收入	16,743.99
合计	284,735.05

#### 6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025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	-

银行间账户维护费	9,000.00
合计	108,178.95

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中信证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日	2024年01月01日至2024年06月30日	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	247,869,657.63	96.36%	29,855,493.66	12.32%
------------	----------------	--------	---------------	--------

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日	成交金额	2024年01月01日至2024年06月30日	占当期债券买卖成交总额的比例
中信证券股份有限公司	27,496,414.80	100.00%	-	-

#### 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 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年01月01日至2025年06月30日	成交金额	2024年01月01日至2024年06月30日	占当期基金成交总额的比例
中信证券股份有限公司	260,812,256.40	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	51,536.21	96.36%	19,159.67	90.77%
关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	13,312.11	12.32%	13,312.11	30.35%

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。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，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。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

#### 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	上年度可比期间

	2025年01月01日至2025年06月30日	2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,090,869.46	1,100,882.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,134,121.66	6,358,144.33
应支付基金管理人的净管理费	-5,043,252.20	-5,257,262.18

注:1、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取0)0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×该日适用费率/当年天数。

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

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	218,173.96	220,176.48

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费，支付基金托管人中信证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取0)0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×该日适用费率/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
----------	-------------------------------

各关联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证食品饮料ETF联接A	天弘中证食品饮料ETF联接C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	24,709.63	24,709.63
中信证券 股份有限 公司	-	2,018.30	2,018.30
合计	-	26,727.93	26,727.93
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
天弘中证食品饮料ETF联接A	天弘中证食品饮料ETF联接C	合计	
天弘基金 管理有限 公司	-	24,780.80	24,780.80
中信证券 股份有限 公司	-	1,056.00	1,056.00
合计	-	25,836.80	25,836.80

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

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘中证食品饮料ETF联接A不收取销售服务费。

#### 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

天弘中证食品饮料ETF联接A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘中证食品饮料ETF联接C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司	257,685,847.33	1,731,036.18	250,470,388.50	2,227,875.27

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 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

称				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

上年度可比期间

2024年01月01日至2024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	001387	雪祺电气	网下申购	1,330	20,455.40
中信证券 股份有限 公司	601033	永兴股份	网下申购	12,577	203,747.40
中信证券 股份有限 公司	688584	上海合晶	网下申购	8,659	196,212.94
中信证券 股份有限 公司	001359	平安电工	网下申购	1,833	31,875.87
中信建投 证券股份 有限公司	301580	爱迪特	网下申购	2,018	90,709.10

有限公司					
------	--	--	--	--	--

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

本报告期末，本基金持有6,373,381,900.00份目标ETF基金份额（上年度末：6,620,300,200.00份），占其总份额的比例为93.91%（上年度末：95.86%）。

#### 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（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603049	中策橡胶	2025-05-27	6个月	新股锁定	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6个月	创业板打新限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6个月	创业板打新限售	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6个月	创业板打新限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
301602	超研股份	2025-01-11	6个月	创业板打	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-

		5		新限售						
3015 01	恒鑫生活	2025 -03-1 1	6个月	创业板打 新股限售	39.92	45.22	241	9,62 0.72	10,89 8.02	-
3015 01	恒鑫生活	2025 -06-0 6	4个月	锁定期送股	-	45.22	109	-	4,92 8.98	-
6032 02	天有为	2025 -04-1 6	6个月	新股锁定	93.50	90.66	166	15,52 1.00	15,04 9.56	-
3014 79	弘景光电	2025 -03-0 6	6个月	创业板打 新股限售	41.90	77.87	130	5,44 7.00	10,12 3.10	-
3014 79	弘景光电	2025 -05-2 8	4个月	锁定期送股	-	77.87	52	-	4,04 9.24	-
3015 35	浙江华远	2025 -03-1 8	6个月	创业板打 新股限售	4.92	18.99	734	3,61 1.28	13,93 8.66	-
0013 88	信通电子	2025 -06-2 4	1个月内 (含)	新股未上 市	16.42	16.42	843	13,84 2.06	13,84 2.06	-
6030 72	天和磁材	2024 -12-2 4	6个月	新股锁定	12.30	54.45	226	2,77 9.80	12,30 5.70	-
3016 62	宏工科技	2025 -04-1 0	6个月	创业板打 新股限售	26.60	82.50	143	3,80 3.80	11,79 7.50	-
3016	惠通	2025	6个月	创业	11.80	33.85	342	4,03	11,57	-

01	科技	-01-08		板打新限售				5.60	6.70	
0013 56	富岭股份	2025 -01-16	6个月	新股锁定	5.30	14.44	709	3,75 7.70	10,23 7.96	-
3015 90	优优绿能	2025 -05-28	6个月	创业板打新限售	89.60	139.48	73	6,54 0.80	10,18 2.04	-
3016 58	首航新能	2025 -03-26	6个月	创业板打新限售	11.80	22.98	437	5,15 6.60	10,04 2.26	-
3016 65	泰禾股份	2025 -04-02	6个月	创业板打新限售	10.27	22.39	393	4,03 6.11	8,79 9.27	-
3011 73	毓恬冠佳	2025 -02-24	6个月	创业板打新限售	28.33	44.98	173	4,90 1.09	7,78 1.54	-
0013 82	新亚电缆	2025 -03-13	6个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,70 8.40	7,39 6.86	-
6030 14	威高血净	2025 -05-12	6个月	新股锁定	26.50	32.68	205	5,43 2.50	6,69 9.40	-
3016 36	泽润新能	2025 -04-30	6个月	创业板打新限售	33.06	47.46	128	4,23 1.68	6,07 4.88	-
3015 95	太力科技	2025 -05-12	6个月	创业板打	17.05	29.10	196	3,34 1.80	5,70 3.60	-

				新限售						
3015 60	众捷 汽车	2025 -04-1 7	6个月	创业板打 新股限售	16.50	27.45	190	3,13 5.00	5,21 5.50	-
6032 10	泰鸿 万立	2025 -04-0 1	6个月	新股 锁定	8.60	15.61	286	2,45 9.60	4,46 4.46	-
6032 71	永杰 新材	2025 -03-0 4	6个月	新股 锁定	20.60	35.08	126	2,59 5.60	4,42 0.08	-
6031 24	江南 新材	2025 -03-1 2	6个月	新股 锁定	10.54	46.31	88	927.5 2	4,07 5.28	-
0013 95	亚联 机械	2025 -01-2 0	6个月	新股 锁定	19.08	47.25	80	1,52 6.40	3,78 0.00	-
6034 09	XD 汇通 控	2025 -02-2 5	6个月	新股 锁定	24.18	33.32	100	2,41 8.00	3,33 2.00	-
0013 90	古麒 绒材	2025 -05-2 1	6个月	新股 锁定	12.08	18.12	178	2,15 0.24	3,22 5.36	-
6032 57	中国 瑞林	2025 -03-2 8	6个月	新股 锁定	20.52	37.47	78	1,60 0.56	2,92 2.66	-
6034 00	华之 杰	2025 -06-1 2	6个月	新股 锁定	19.88	43.81	57	1,13 3.16	2,49 7.17	-
6033 82	海阳 科技	2025 -06-0 5	6个月	新股 锁定	11.50	22.39	105	1,20 7.50	2,35 0.95	-
0013 35	信凯 科技	2025 -04-0 2	6个月	新股 锁定	12.80	28.05	80	1,02 4.00	2,24 4.00	-

6031 20	肯特 催化	2025 -04-0 9	6个月	新股 锁定	15.00	33.43	65	975.0 0	2,17 2.95	-
0013 88	信通 电子	2025 -06-2 4	6个月	新股 锁定	16.42	16.42	94	1,54 3.48	1,54 3.48	-

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股 票 代 码	股 票 名 称	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 (股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
600 962	国 投 中 鲁	202 5-0 6-2 3	拟 筹 划 重 大 资 产 重 组	13.4 3	202 5-07 -07	14.7 7	22,300	302,793.81	299,489.00	-

注：本基金截至2025年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 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2025年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

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

本基金管理人按照“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债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，对不同的债券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且债券证券公司最近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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	21,186,353.28	68,506,440.65
合计	21,186,353.28	68,506,440.65

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

#### 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于2025年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

#### 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 2025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	257,685,847.3 3	-	-	-	257,685,847.33
存出保证金	258,196.64	-	-	-	258,196.64
交易性金融资产	21,186,353.28	-	-	4,600,163,674.5 2	4,621,350,027.8 0
应收申购款	-	-	-	14,570,164.57	14,570,164.57
资产总计	279,130,397.2 5	-	-	4,614,733,839.0 9	4,893,864,236.3 4
负债					
应付清算款	-	-	-	4,810,725.23	4,810,725.23
应付赎回款	-	-	-	18,282,912.90	18,282,912.90
应付管理人报酬	-	-	-	181,084.32	181,084.32
应付托管费	-	-	-	36,216.88	36,216.88
应付销售服务费	-	-	-	642,958.44	642,958.44
其他负债	-	-	-	126,310.54	126,310.54
负债总计	-	-	-	24,080,208.31	24,080,208.31
利率敏感度缺口	279,130,397.2 5	-	-	4,590,653,630.7 8	4,869,784,028.0 3
上年度末 2024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	222,025,470.4 4	-	-	-	222,025,470.44
结算备付金	804,422.89	-	-	-	804,422.89
存出保证金	429,224.49	-	-	-	429,224.49
交易性金融资产	68,506,440.65	-	-	4,995,486,316.5 5	5,063,992,757.2 0
应收申购款	-	-	-	17,630,523.76	17,630,523.76
资产总计	291,765,558.4 7	-	-	5,013,116,840.3 1	5,304,882,398.7 8
负债					
应付清算款	-	-	-	5,317,858.38	5,317,858.38
应付赎回款	-	-	-	20,530,433.25	20,530,433.25
应付管理人报酬	-	-	-	191,817.19	191,817.19
应付托管费	-	-	-	38,363.43	38,363.43
应付销售服务费	-	-	-	721,845.13	721,845.13

其他负债	-	-	-	216,209.35	216,209.35
负债总计	-	-	-	27,016,526.73	27,016,526.73
利率敏感度缺口	291,765,558.4 7	-	-	4,986,100,313.5 8	5,277,865,872.0 5

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2025年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.44%(2024年12月31日：1.30%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标ETF份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金的其他价格风险与目标ETF基金类似。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

#### 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 2025年06月30日		上年度末 2024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	192,970,090.67	3.96	179,217,921.05	3.40
交易性金融资产—基金投资	4,407,193,583.85	90.50	4,816,268,395.50	91.25
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	4,600,163,674.52	94.46	4,995,486,316.55	94.65

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 分析	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	240,808,638.26	262,488,589.60
	业绩比较基准下降5%	-240,808,638.26	-262,488,589.60

#### 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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	4,599,529,939.68	4,994,992,507.89
第二层次	21,501,227.82	68,534,177.15
第三层次	318,860.30	466,072.16
合计	4,621,350,027.80	5,063,992,757.20

#### 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2025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(2024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	192,970,090.67	3.94
	其中：股票	192,970,090.67	3.94

2	基金投资	4,407,193,583.85	90.06
3	固定收益投资	21,186,353.28	0.43
	其中：债券	21,186,353.28	0.43
	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	257,685,847.33	5.27
8	其他各项资产	14,828,361.21	0.30
9	合计	4,893,864,236.34	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	190,715,948.31	3.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,526,464.00	0.03
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	14,499.36	0.00
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	713,179.00	0.01
	合计	192,970,090.67	3.96

### 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

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	700,580	19,532,170.40	0.40
2	000858	五粮液	161,335	19,182,731.50	0.39
3	600519	贵州茅台	13,409	18,900,253.68	0.39
4	600809	山西汾酒	69,612	12,278,860.68	0.25
5	000568	泸州老窖	104,998	11,906,773.20	0.24
6	605499	东鹏饮料	29,580	9,289,599.00	0.19
7	603288	海天味业	238,142	9,266,105.22	0.19
8	002304	洋河股份	85,952	5,548,201.60	0.11
9	603369	今世缘	106,751	4,155,816.43	0.09
10	000895	双汇发展	148,457	3,623,835.37	0.07
11	600600	青岛啤酒	50,464	3,505,229.44	0.07
12	300765	新诺威	60,131	3,108,171.39	0.06
13	000596	古井贡酒	23,183	3,086,816.45	0.06
14	600298	安琪酵母	86,665	3,048,008.05	0.06
15	000729	燕京啤酒	201,225	2,601,839.25	0.05
16	300999	金龙鱼	85,084	2,512,530.52	0.05
17	603345	安井食品	29,206	2,348,746.52	0.05
18	002568	百润股份	74,799	1,915,602.39	0.04
19	600132	重庆啤酒	34,452	1,898,305.20	0.04
20	603589	口子窖	51,306	1,785,448.80	0.04

21	600559	老白干酒	104,444	1,749,437.00	0.04
22	600702	舍得酒业	33,200	1,706,480.00	0.04
23	600872	中炬高新	88,913	1,689,347.00	0.03
24	300146	汤臣倍健	145,611	1,636,667.64	0.03
25	600186	莲花控股	256,300	1,537,800.00	0.03
26	603156	养元饮品	71,837	1,520,070.92	0.03
27	002507	涪陵榨菜	115,343	1,475,236.97	0.03
28	600737	中粮糖业	152,600	1,442,070.00	0.03
29	000799	酒鬼酒	32,363	1,423,648.37	0.03
30	603198	迎驾贡酒	34,183	1,347,835.69	0.03
31	002847	盐津铺子	15,420	1,239,768.00	0.03
32	600779	水井坊	27,698	1,181,042.72	0.02
33	000860	顺鑫农业	74,117	1,152,519.35	0.02
34	002597	金禾实业	48,600	1,144,530.00	0.02
35	600882	妙可蓝多	36,401	1,111,322.53	0.02
36	600059	古越龙山	91,091	993,802.81	0.02
37	002570	贝因美	154,139	983,406.82	0.02
38	002557	洽洽食品	43,297	936,081.14	0.02
39	300783	三只松鼠	34,200	927,162.00	0.02
40	002626	金达威	43,400	887,964.00	0.02
41	603027	千禾味业	73,254	850,478.94	0.02
42	600597	光明乳业	98,461	828,057.01	0.02
43	000848	承德露露	90,150	823,069.50	0.02
44	002515	金字火腿	138,300	810,438.00	0.02
45	600199	金种子酒	75,028	810,302.40	0.02
46	603517	绝味食品	51,769	789,477.25	0.02
47	600305	恒顺醋业	94,742	732,355.66	0.02
48	000833	粤桂股份	57,100	713,179.00	0.01
49	002461	珠江啤酒	63,050	711,834.50	0.01
50	600073	光明肉业	93,664	691,240.32	0.01
51	601579	会稽山	34,100	678,931.00	0.01

52	603919	金徽酒	36,106	653,518.60	0.01
53	603866	桃李面包	114,360	617,544.00	0.01
54	600197	伊力特	40,503	604,304.76	0.01
55	300973	立高食品	11,960	583,289.20	0.01
56	002726	龙大美食	99,969	581,819.58	0.01
57	002481	双塔食品	105,600	558,624.00	0.01
58	002216	三全食品	50,222	555,957.54	0.01
59	000523	红棉股份	169,900	553,874.00	0.01
60	600300	维维股份	161,600	549,440.00	0.01
61	603317	天味食品	45,550	506,516.00	0.01
62	603043	广州酒家	32,433	505,306.14	0.01
63	605016	百龙创园	23,943	493,944.09	0.01
64	605077	华康股份	30,200	488,636.00	0.01
65	002840	华统股份	45,887	477,683.67	0.01
66	002946	新乳业	24,605	461,835.85	0.01
67	600189	泉阳泉	61,180	442,943.20	0.01
68	600784	鲁银投资	67,400	431,360.00	0.01
69	000716	黑芝麻	69,800	429,968.00	0.01
70	001338	永顺泰	35,700	425,544.00	0.01
71	003000	劲仔食品	32,100	424,683.00	0.01
72	300791	仙乐健康	17,502	416,722.62	0.01
73	002646	天佑德酒	41,257	382,864.96	0.01
74	002956	西麦食品	15,800	370,826.00	0.01
75	688089	嘉必优	14,412	362,461.80	0.01
76	300858	科拓生物	22,450	349,995.50	0.01
77	000639	西王食品	107,784	347,064.48	0.01
78	603719	良品铺子	28,500	346,275.00	0.01
79	605179	一鸣食品	17,000	342,720.00	0.01
80	301206	三元生物	11,400	328,434.00	0.01
81	002991	甘源食品	5,200	324,844.00	0.01
82	605198	安德利	7,700	310,387.00	0.01

83	600962	国投中鲁	22,300	299,489.00	0.01
84	002695	煌上煌	31,823	299,136.20	0.01
85	000505	京粮控股	47,100	298,143.00	0.01
86	600429	三元股份	64,500	290,895.00	0.01
87	605337	李子园	22,374	286,387.20	0.01
88	605388	均瑶健康	34,200	281,808.00	0.01
89	603057	紫燕食品	11,700	255,762.00	0.01
90	605338	巴比食品	13,600	255,000.00	0.01
91	000529	广弘控股	41,600	254,176.00	0.01
92	603777	来伊份	19,100	250,783.00	0.01
93	300908	仲景食品	8,199	246,871.89	0.01
94	603697	有友食品	18,200	240,058.00	0.00
95	603237	五芳斋	14,000	233,940.00	0.00
96	600965	福成股份	46,600	229,272.00	0.00
97	300997	欢乐家	12,428	219,229.92	0.00
98	603711	香飘飘	11,600	161,936.00	0.00
99	001318	阳光乳业	12,000	158,280.00	0.00
100	605300	佳禾食品	8,900	124,689.00	0.00
101	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
102	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
103	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
104	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
105	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
106	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
107	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
108	603202	天有为	166	15,049.56	0.00
109	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
110	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00
111	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
112	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
113	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00

114	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
115	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
116	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
117	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
118	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
119	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
120	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
121	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
122	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
123	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
124	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
125	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
126	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
127	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
128	603409	XD汇通控	100	3,332.00	0.00
129	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
130	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
131	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
132	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
133	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
134	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	600887	伊利股份	12,071,420.20	0.23
2	600519	贵州茅台	11,946,190.00	0.23
3	000858	五粮液	10,994,193.00	0.21

4	600809	山西汾酒	8,790,851.00	0.17
5	000568	泸州老窖	6,352,784.00	0.12
6	603288	海天味业	5,991,024.38	0.11
7	605499	东鹏饮料	4,481,735.00	0.08
8	603369	今世缘	3,276,114.00	0.06
9	002304	洋河股份	3,032,619.00	0.06
10	600600	青岛啤酒	2,289,214.00	0.04
11	000895	双汇发展	1,897,285.00	0.04
12	600298	安琪酵母	1,878,118.00	0.04
13	000596	古井贡酒	1,731,253.00	0.03
14	603345	安井食品	1,403,215.42	0.03
15	300999	金龙鱼	1,291,754.00	0.02
16	600132	重庆啤酒	1,207,561.97	0.02
17	000729	燕京啤酒	1,196,209.00	0.02
18	300765	新诺威	1,182,799.00	0.02
19	600559	老白干酒	1,174,993.00	0.02
20	600872	中炬高新	1,132,286.00	0.02

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交量）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	000858	五粮液	18,775,141.00	0.36
2	000568	泸州老窖	13,053,401.18	0.25
3	600887	伊利股份	10,180,320.00	0.19
4	600519	贵州茅台	9,771,330.00	0.19
5	600809	山西汾酒	7,064,009.85	0.13
6	002304	洋河股份	6,275,952.94	0.12

7	603288	海天味业	4,841,566.00	0.09
8	000596	古井贡酒	4,415,453.00	0.08
9	000895	双汇发展	3,874,985.00	0.07
10	605499	东鹏饮料	3,419,000.80	0.06
11	603369	今世缘	2,700,041.00	0.05
12	300999	金龙鱼	2,677,475.00	0.05
13	000729	燕京啤酒	2,414,535.00	0.05
14	300765	新诺威	2,106,584.60	0.04
15	002568	百润股份	1,880,067.00	0.04
16	600600	青岛啤酒	1,780,131.00	0.03
17	300146	汤臣倍健	1,661,387.00	0.03
18	600298	安琪酵母	1,536,677.00	0.03
19	002507	涪陵榨菜	1,523,494.78	0.03
20	000799	酒鬼酒	1,358,626.00	0.03

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）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	115,133,054.90
卖出股票收入（成交）总额	143,763,805.01

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	21,186,353.28	0.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,186,353.28	0.44

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019758	24国债21	160,000	16,143,570.41	0.33
2	019749	24国债15	25,000	2,531,764.38	0.05
3	019766	25国债01	25,000	2,511,018.49	0.05

#### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	天弘中证食品饮料	股票型	交易型开放式	天弘基金管理有限	4,407,193,583.85	90.50

交易型开放式指数 证券投资 基金			公司		
------------------------	--	--	----	--	--

### 7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.13 投资组合报告附注

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

7.13.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	258,196.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,570,164.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,828,361.21

### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
天弘 中证 食品 饮料E TF联 接A	25 3,6 41	1,780.78	820,373.77	0.18%	450,857,566.43	99.82%
天弘 中证 食品 饮料E TF联 接C	1,4 55, 929	1,259.57	22,530,067.26	1.23%	1,811,312,536.55	98.77%
合计	1,6 87, 764	1,354.17	23,350,441.03	1.02%	2,262,170,102.98	98.98%

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	天弘中证食品饮料E TF联接A	62,126.54	0.01%
	天弘中证食品饮料E TF联接C	219,664.81	0.01%
	合计	281,791.35	0.01%

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证食品饮料ETF 联接A	天弘中证食品饮料ETF 联接C
基金合同生效日(2015年07月29 日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	469,099,045.72	1,892,349,282.49
本报告期基金总申购份额	76,849,153.28	760,096,834.97
减：本报告期基金总赎回份额	94,270,258.80	818,603,513.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	451,677,940.20	1,833,842,603.81
--------------	----------------	------------------

## §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，未发生管理人的重大人事变动。

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管理人、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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	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	佣金	占当期 佣金总 量的比	

	数量		的比例		比例	
东方财富证券	2	9,369,342.24	3.64%	1,948.05	3.64%	-
国联民生证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	7	247,869,657.63	96.36%	51,536.21	96.36%	-

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：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国联民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	27,496,414.80	100.00%	-	-	-	-	260,812,256.40	100.00%

## 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联接基金2024年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
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	2025-03-14
3	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	2025-03-29
4	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金2024年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-31
5	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（2024年下半年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
6	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	2025-04-12
7	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	2025-04-18
8	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接	中国证监会规定媒介	2025-04-22

	基金2025年第1季度报告		
9	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金(A类份额)基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2025-06-27
10	天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金(C类份额)基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2025-06-27

## §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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 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  
二〇二五年八月二十九日