

# 国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金

## 2023 年第 2 季度报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                               |
|------------|-----------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰国证食品饮料行业指数                                  |
| 场内简称       | 食品 LOF                                        |
| 基金主代码      | 160222                                        |
| 交易代码       | 160222                                        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                        |
| 基金合同生效日    | 2021 年 1 月 1 日                                |
| 报告期末基金份额总额 | 5,175,438,557.54 份                            |
| 投资目标       | 本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略       | 1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略。      |
| 业绩比较基准     | 国证食品饮料行业指数收益率×95%+银行活期存                       |

|                 |                                                                   |                 |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                 | 款利率（税后）×5%                                                        |                 |
| 风险收益特征          | 本基金为股票型指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |                 |
| 基金管理人           | 国泰基金管理有限公司                                                        |                 |
| 基金托管人           | 中国农业银行股份有限公司                                                      |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰国证食品饮料行业指数 A                                                    | 国泰国证食品饮料行业指数 C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 160222                                                            | 015040          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 5,137,105,665.98 份                                                | 38,332,891.56 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期<br>(2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |                    |
|----------------|-----------------------------------------|--------------------|
|                | 国泰国证食品饮料行业<br>指数 A                      | 国泰国证食品饮料行业<br>指数 C |
| 1.本期已实现收益      | 74,277,101.91                           | 526,708.94         |
| 2.本期利润         | -753,538,644.77                         | -8,312,711.92      |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1469                                 | -0.1280            |
| 4.期末基金资产净值     | 5,002,276,466.74                        | 37,176,801.58      |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9738                                  | 0.9698             |

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，本期利润为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。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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

#### 1、国泰国证食品饮料行业指数 A：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | -13.13%    | 1.16%         | -14.38%        | 1.17%                 | 1.25% | -0.01% |
| 过去六个月          | -10.00%    | 1.23%         | -10.75%        | 1.25%                 | 0.75% | -0.02% |
| 过去一年           | -19.40%    | 1.41%         | -20.28%        | 1.47%                 | 0.88% | -0.06% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -28.01%    | 1.69%         | -30.18%        | 1.75%                 | 2.17% | -0.06% |

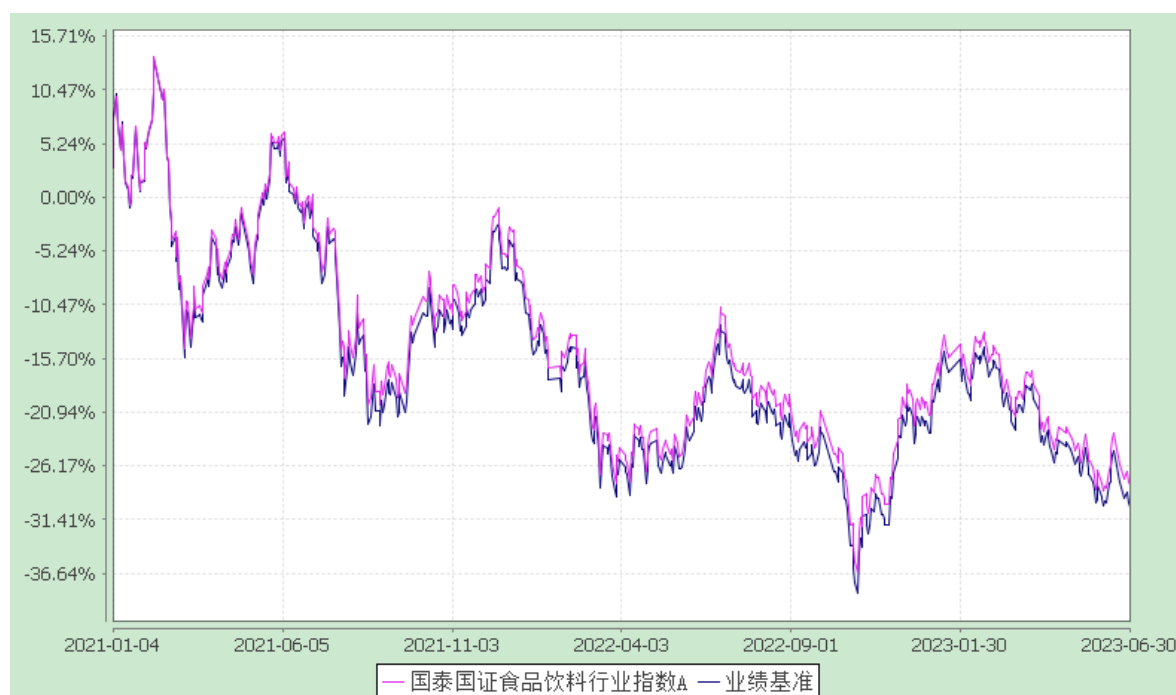
#### 2、国泰国证食品饮料行业指数 C：

| 阶段               | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③   | ②—④    |
|------------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月            | -13.21%    | 1.16%         | -14.38%        | 1.17%                 | 1.17% | -0.01% |
| 过去六个月            | -10.15%    | 1.23%         | -10.75%        | 1.25%                 | 0.60% | -0.02% |
| 过去一年             | -19.65%    | 1.41%         | -20.28%        | 1.47%                 | 0.63% | -0.06% |
| 自新增 C 类<br>份额起至今 | -17.29%    | 1.54%         | -18.30%        | 1.59%                 | 1.01% | -0.05% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2021 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日)

#### 1. 国泰国证食品饮料行业指数 A：



注：本基金合同生效日为 2021 年 1 月 1 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## 2. 国泰国证食品饮料行业指数 C:



注：本基金合同生效日为 2021 年 1 月 1 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自 2022 年 2 月 16 日起，本基金增加 C 类份额并分别设置对应的基金代码；自 2022 年 2 月 17 日起，C 类基金份额净值和基金份额累计净值开始计算。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务                                                                                 | 任本基金的基金经理<br>期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|----|------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                    | 任职日期            | 离任日期 |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 梁杏 | 国泰国证生物医药 ETF 联接、国泰国证医药卫生行业指数、国泰国证食品饮料行业指数、国泰量化收益灵活配置混合、国泰中证生物医药 ETF、国泰 CES 半导体芯片行业 | 2016-06-08      | -    | 16 年       | 学士。2007 年 7 月至 2011 年 6 月在华安基金管理有限公司担任高级区域经理。2011 年 7 月加入国泰基金，历任产品品牌经理、研究员、基金经理助理。2016 年 6 月至 2020 年 12 月任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2019 年 4 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 7 月起兼任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 4 月起兼任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 11 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）的基金经理，2020 年 1 月至 2021 年 1 月任国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易 |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                        |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ETF 联接、国<br>泰上<br>证综<br>合<br>ETF、<br>国泰<br>中证<br>医疗<br>ETF、<br>国泰<br>中证<br>畜牧<br>养殖<br>ETF、<br>国泰<br>中证<br>医疗<br>ETF 联<br>接、国<br>泰中<br>证全<br>指软<br>件 ETF<br>联接、<br>国泰<br>中证<br>畜牧<br>养殖<br>ETF 联<br>接、国<br>泰中<br>证沪<br>港深<br>创新<br>药产<br>业<br>ETF、<br>国泰<br>中证<br>沪港<br>深创<br>新药<br>产业 |  |  |  | 型开放式指数证券投资基金和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2020 年 8 月起兼任国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2020 年 12 月起兼任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2021 年 1 月起兼任国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金(由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来)、国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金(由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来)的基金经理,2021 年 1 月至 2022 年 2 月任国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理,2021 年 2 月至 2022 年 2 月任国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2021 年 3 月起兼任国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2021 年 6 月起兼任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理,2021 年 7 月起兼任国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理,2021 年 9 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2021 年 11 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                               |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | ETF 发起联接、国<br>泰沪<br>深 300<br>增强<br>策略<br>ETF、<br>国泰<br>富时<br>中国<br>国企<br>开放<br>共赢<br>ETF 的<br>基金<br>经理、<br>国泰<br>中证<br>港股<br>通科<br>技<br>ETF、<br>国泰<br>中证<br>有色<br>金属<br>矿业<br>主题<br>ETF、<br>国泰<br>中证<br>有色<br>金属<br>ETF 的<br>基金<br>经理，<br>量化<br>投资<br>部总<br>监 |  |  |  | 的基金经理，2021 年 12 月起兼任国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金和国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 1 月起兼任国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月至 2018 年 7 月任量化投资部副总监，2018 年 7 月起任量化投资部总监。 |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。



2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金组合与其他投资组合之间，由于组合流动性管理或投资策略调整需要，参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 1 次。本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度 GDP 增速达到 4.5%，远超市场预期。然而 4 月经济数据突然走弱，5

月、6 月经济数据比 4 月份改善不多，基本面支撑放缓。叠加美联储继续维持加息态度，压制了市场的风险偏好。市场越发期待政策组合拳的出台，但是预期迟迟未能兑现，于是股市呈现弱势整理状态。

二季度沪深 300 指数下跌 5.15%，国证食品指数下跌 15.1%，国泰国证食品基金净值下跌 13.13%，较好地实现了对标的指数的跟踪。我们在去年年报里判断 2023 年食品饮料指数可能会随着疫后修复迎来一定的反弹，不过由于居民消费意愿在疫情前就缓慢下滑，2020 年-2022 年由于疫情进一步受到影响，2023 年消费意愿预计会出现反弹，但或许不能回到 2019 年的水平。叠加 2020 年食品饮料行业估值冲到历史高位后，2021 年和 2022 年虽然出现了调整，但估值未调整至较低位置，因此可能会制约食品饮料指数反弹的高度。一季度食品饮料行业先涨后跌，二季度持续调整，该判断基本得到了兑现。长期来看，食品饮料行业本身作为常青行业，投资机会依然较好，建议遇调整可继续关注或者考虑定投食品饮料行业的相关产品，做好逢低分批布局工作。

作为行业指数基金，本基金旨在为投资者提供行业投资工具。本报告期内，我们根据对市场行情、日常申赎情况和成份股停复牌的分析判断，对股票仓位及头寸进行了合理安排，将跟踪误差控制在合理水平，尽量为投资者提供更精准的投资工具。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为-13.13%，同期业绩比较基准收益率为-14.38%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-13.21%，同期业绩比较基准收益率为-14.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们维持以下判断：2023 年食品饮料指数可能会随着疫后修复迎来一定的反弹，不过由于居民消费意愿在疫情前就缓慢下滑，2020 年-2022 年由于疫情进一步受到影响，2023 年消费意愿预计会出现反弹，但或许不能回到 2019 年的水平。叠加 2020 年食品饮料行业估值冲到历史高位后，2021 年和 2022 年虽然出现了调整，但估值未调整至较低位置，因此可能会制约食品饮料指数反弹的高度。

长期来看，食品饮料行业本身作为常青行业，投资机会依然较好，建议遇调整可继续关注或者考虑定投食品饮料行业的相关产品，做好逢低分批布局工作。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 4,656,885,105.29 | 92.19        |
|    | 其中：股票             | 4,656,885,105.29 | 92.19        |
| 2  | 固定收益投资            | 60,974,913.94    | 1.21         |
|    | 其中：债券             | 60,974,913.94    | 1.21         |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —                | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | —                | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —                | —            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 325,687,992.53   | 6.45         |
| 7  | 其他各项资产            | 7,600,821.70     | 0.15         |
| 8  | 合计                | 5,051,148,833.46 | 100.00       |

注：报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为383,614,589.50元，占基金资产净值比例为7.61%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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              | 10,875,952.52 | 0.22         |
| 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           | 30,441.28     | 0.00         |
| 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  | 80,548.12     | 0.00         |
| 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       | 37,242.13     | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 7,740.00      | 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          | 80,178.86     | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —             | —            |
| S  | 综合               | —             | —            |
|    | 合计               | 11,158,066.53 | 0.22         |

### 5.2.2 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              | 4,639,437,023.76 | 92.06 |
| 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           | 6,290,015.00     | 0.12  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | —                | —     |
| H | 住宿和餐饮业           | —                | —     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —                | —     |
| J | 金融业              | —                | —     |
| K | 房地产业             | —                | —     |
| L | 租赁和商务服务业         | —                | —     |
| M | 科学研究和技术服务业       | —                | —     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | —                | —     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | —                | —     |
| P | 教育               | —                | —     |
| Q | 卫生和社会工作          | —                | —     |
| R | 文化、体育和娱乐业        | —                | —     |
| S | 综合               | —                | —     |
|   | 合计               | 4,645,727,038.76 | 92.19 |

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)      | 公允价值(元)        | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|----------------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 422,531    | 714,499,921.00 | 14.18                |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 4,258,617  | 696,581,982.69 | 13.82                |
| 3  | 600887 | 伊利股份 | 16,837,916 | 476,849,781.12 | 9.46                 |
| 4  | 000568 | 泸州老窖 | 2,088,611  | 437,710,207.27 | 8.69                 |

|    |        |      |           |                |      |
|----|--------|------|-----------|----------------|------|
| 5  | 002304 | 洋河股份 | 1,683,369 | 221,110,518.15 | 4.39 |
| 6  | 600809 | 山西汾酒 | 1,110,383 | 205,498,581.81 | 4.08 |
| 7  | 603288 | 海天味业 | 4,171,129 | 195,417,393.65 | 3.88 |
| 8  | 603369 | 今世缘  | 2,015,555 | 106,421,304.00 | 2.11 |
| 9  | 000596 | 古井贡酒 | 401,784   | 99,393,325.92  | 1.97 |
| 10 | 600600 | 青岛啤酒 | 856,949   | 88,805,624.87  | 1.76 |

### 5.3.2 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前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|----------------------|
| 1  | 600197 | 伊力特  | 355,758 | 9,665,944.86 | 0.19                 |
| 2  | 688249 | 晶合集成 | 7,405   | 133,734.30   | 0.00                 |
| 3  | 688472 | 阿特斯  | 6,261   | 106,687.44   | 0.00                 |
| 4  | 301488 | 豪恩汽电 | 2,618   | 104,144.04   | 0.00                 |
| 5  | 688429 | 时创能源 | 3,452   | 98,752.08    | 0.00                 |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)       | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|-----------|---------------|----------------------|
| 1  | 国家债券      | 60,974,913.94 | 1.21                 |
| 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   | 60,974,913.94 | 1.21 |

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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张)   | 公允价值<br>(元)   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|----------------------|
| 1  | 019688 | 22 国债 23 | 603,000 | 60,974,913.94 | 1.21                 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 186,246.08   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | 823,118.40   |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 6,389,872.87 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | 201,584.35   |
| 9  | 合计      | 7,600,821.70 |

### 5.11.4 报告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可转换债券。

### 5.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值<br>(元) | 占基金资产<br>净值比例(%) | 流通受限<br>情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|------------------|--------------|
| 1  | 603288 | 海天味业 | 62,024,715.00      | 1.23             | 转融通证券出借业务的股票 |
| 2  | 000596 | 古井贡酒 | 17,514,504.00      | 0.35             | 转融通证券出借业务的股票 |
| 3  | 000568 | 泸州老窖 | 12,888,555.00      | 0.26             | 转融通证券出借业务的股票 |
| 4  | 600600 | 青岛啤酒 | 11,886,361.00      | 0.24             | 转融通证券出借业务的股票 |
| 5  | 603369 | 今世缘  | 8,706,720.00       | 0.17             | 转融通证         |



|    |        |      |              |      |              |
|----|--------|------|--------------|------|--------------|
|    |        |      |              |      | 券出借业务的股票     |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 8,571,068.00 | 0.17 | 转融通证券出借业务的股票 |
| 7  | 600519 | 贵州茅台 | 4,565,700.00 | 0.09 | 转融通证券出借业务的股票 |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 3,353,088.00 | 0.07 | 转融通证券出借业务的股票 |
| 9  | 600809 | 山西汾酒 | 3,090,669.00 | 0.06 | 转融通证券出借业务的股票 |
| 10 | 002304 | 洋河股份 | 2,929,105.00 | 0.06 | 转融通证券出借业务的股票 |

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值<br>(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------------|--------------|----------|
| 1  | 688249 | 晶合集成 | 133,734.30         | 0.00         | 新股锁定     |
| 2  | 688472 | 阿特斯  | 106,687.44         | 0.00         | 新股锁定     |
| 3  | 301488 | 豪恩汽电 | 93,721.68          | 0.00         | 网下中签     |
| 4  | 301488 | 豪恩汽电 | 10,422.36          | 0.00         | 新股锁定     |
| 5  | 688429 | 时创能源 | 8,833.38           | 0.00         | 新股锁定     |

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 国泰国证食品饮料行业<br>指数A | 国泰国证食品饮料行业<br>指数C |
|----------------|-------------------|-------------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 5,119,625,082.11  | 65,196,876.46     |
| 报告期期间基金总申购份额   | 323,352,754.98    | 68,538,235.63     |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 305,872,171.11    | 95,402,220.53     |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                 | -                 |

|             |                  |               |
|-------------|------------------|---------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 5,137,105,665.98 | 38,332,891.56 |
|-------------|------------------|---------------|

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金基金合同
- 2、国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金变更注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 8.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

基金托管人住所。

### 8.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇二三年七月二十一日