

---

# 兴业数字经济优选股票型证券投资基金

## 2024年第2季度报告

### 2024年06月30日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年7月17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2024年04月01日起至06月30日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 兴业数字经济优选股票  |
| 基金主代码      | 016647  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2022年10月12日   |
| 报告期末基金份额总额 | 46,416,167.75份  |
| 投资目标       | 本基金主要投资于数字经济主题相关行业的上市公司，通过自下而上的深度挖掘，精选个股，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略       | 本基金把握宏观经济和投资市场的变化趋势，动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，有效分散风险，力求获取超额收益。<br>主要投资策略为大类资产配置策略、股票投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券投资策略、可交换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 中证TMT产业主题指数收益率*65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*15%+中债综合全价指数收益率*20%  |

|                 |  |                |
|-----------------|--|----------------|
| 风险收益特征          | 本基金为股票型基金，其预期收益和风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。<br>本基金若投资港股通标的股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |                |
| 基金管理人           | 兴业基金管理有限公司   |                |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司   |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 兴业数字经济优选股票 A   | 兴业数字经济优选股票 C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 016647   | 016648         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 29,086,578.13份   | 17,329,589.62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(2024年04月01日 - 2024年06月30日) |               |
|----------------|--------------------------------|---------------|
|                | 兴业数字经济优选股票A                    | 兴业数字经济优选股票C   |
| 1.本期已实现收益      | -2,027,694.48                  | -1,377,130.31 |
| 2.本期利润         | -1,100,144.80                  | -691,998.57   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0375                        | -0.0368       |
| 4.期末基金资产净值     | 21,493,828.89                  | 12,691,997.12 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.7390                         | 0.7324        |

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 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

兴业数字经济优选股票A净值表现

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

|                | 率①      | 率标准差<br>② | 基准收益<br>率③ | 基准收益<br>率标准差<br>④ |         |       |
|----------------|---------|-----------|------------|-------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -4.82%  | 1.81%     | 0.78%      | 1.04%             | -5.60%  | 0.77% |
| 过去六个月          | -13.25% | 2.18%     | -3.10%     | 1.36%             | -10.15% | 0.82% |
| 过去一年           | -23.43% | 1.89%     | -14.62%    | 1.17%             | -8.81%  | 0.72% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -26.10% | 1.62%     | 7.88%      | 1.16%             | -33.98% | 0.46% |

### 兴业数字经济优选股票C净值表现

| 阶段             | 净值增长<br>率① | 净值增长<br>率标准差<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④   |
|----------------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | -4.94%     | 1.81%             | 0.78%              | 1.04%                     | -5.72%  | 0.77% |
| 过去六个月          | -13.47%    | 2.18%             | -3.10%             | 1.36%                     | -10.37% | 0.82% |
| 过去一年           | -23.82%    | 1.89%             | -14.62%            | 1.17%                     | -9.20%  | 0.72% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -26.76%    | 1.62%             | 7.88%              | 1.16%                     | -34.64% | 0.46% |

注：本基金的业绩比较基准为：中证 TMT 产业主题指数收益率\*65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率\*15%+中债综合全价指数收益率\*20%。

### 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

兴业数字经济优选股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



兴业数字经济优选股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



## §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期限 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

|     |      | 任职日期       | 离任日期 | 年限 |   |
|-----|------|------------|------|----|---|
| 廖欢欢 | 基金经理 | 2022-10-12 | -    | 6年 | 中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2011年7月至2013年8月，在通用电气（中国）研究开发中心担任系统工程师；2013年8月2017年7月，在兴业银行总行银行合作中心银银平台和钱大掌柜担任架构师；2017年8月加入兴业基金管理有限公司，现任基金经理。 |

- 1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
- 2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则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。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

目前组合配置聚焦在AI算力、半导体设计及设备零部件。近期增持了半导体设备零部件公司。未来继续重点关注国产算力和设备零部件领域的创新，自下而上寻找机会。

半导体产业链，需求国内外呈现弱复苏特征。存储合约价格Q3继续上行，是历次行业复苏的领先指标。大基金三期成立，未来先进制程、先进封装和设备材料零部件领域的国产化会持续推进。

AIGC引发产业变革的路径可能是曲折和反复的，海外头部公司之间的差距在缩小，巨头下半年继续加大硬件投入。国内大厂的文生视频类SORA应用内测效果超预期。苹果下半年发布AI手机，市场对龙头引领换机充满期待。

综上，我们对这一轮技术创新充满信心，对中国科技产业的持续升级充满期待。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业数字经济优选股票A基金份额净值为0.7390元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.82%，同期业绩比较基准收益率为0.78%；截至报告期末兴业数字经济优选股票C基金份额净值为0.7324元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.94%，同期业绩比较基准收益率为0.78%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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数量不满二百人的情形。

本基金自2023年11月21日起至2024年6月30日止基金资产净值低于五千万，已连续六十个工作日以上，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

### §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              | 29,911,106.46 | 86.78         |
|    | 其中：股票             | 29,911,106.46 | 86.78         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 2,336,098.66  | 6.78          |
|    | 其中：债券             | 2,336,098.66  | 6.78          |
|    | 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 | 2,162,564.57  | 6.27   |
| 8 | 其他资产         | 58,841.90     | 0.17   |
| 9 | 合计           | 34,468,611.59 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末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              | 21,629,343.80 | 63.27        |
| 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  | 7,062,532.66  | 20.66        |
| 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       | 1,219,230.00  | 3.57         |
| 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               | 29,911,106.46 | 87.50        |

### 5.2.2 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通过港股通交易机制投资的股票。

### 5.3 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)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创   | 19,660  | 2,710,720.80 | 7.93         |
| 2  | 688256 | 寒武纪-U  | 13,486  | 2,679,263.62 | 7.84         |
| 3  | 688141 | 杰华特    | 160,719 | 2,597,219.04 | 7.60         |
| 4  | 688041 | 海光信息   | 36,600  | 2,573,712.00 | 7.53         |
| 5  | 688702 | 盛科通信-U | 44,100  | 1,786,050.00 | 5.22         |
| 6  | 601138 | 工业富联   | 63,200  | 1,731,680.00 | 5.07         |
| 7  | 688012 | 中微公司   | 11,700  | 1,652,742.00 | 4.83         |
| 8  | 002409 | 雅克科技   | 26,200  | 1,648,242.00 | 4.82         |
| 9  | 688498 | 源杰科技   | 11,800  | 1,545,682.00 | 4.52         |
| 10 | 688361 | 中科飞测   | 29,200  | 1,381,160.00 | 4.04         |

### 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)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 2,336,098.66 | 6.83         |
| 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        | 2,336,098.66 | 6.83         |

### 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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

|   |        |        |        |              |      |
|---|--------|--------|--------|--------------|------|
| 1 | 019693 | 22国债28 | 23,000 | 2,336,098.66 | 6.83 |
|---|--------|--------|--------|--------------|------|

**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序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**

**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金管理人以套期保值为目的，根据风险管理的原则，将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资范围不包括国债期货。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金投资范围不包含国债期货。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金投资范围不包括国债期货。

**5.11 投资组合报告附注**

**5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，本基金投资的前十名证券的发行主体除杰华特外未发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。**

**杰华特：2023年7月14号收到浙江证监局关于业绩预测结果不准确的警示函。2024年5月29号、6月4号和6月17号收到浙江证监局关于募集资金管理使用违规的警示函。**

本基金管理人的研究部门对杰华特保持了及时的研究跟踪，投资决策符合本基金管理人的投资流程。

**5.11.2 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。**

**5.11.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 10,190.43 |
| 2  | 应收证券清算款 | 9,683.62  |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 38,967.85 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 58,841.90 |

**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 报告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。

**§6 开放式基金份额变动**

单位：份

|                               | 兴业数字经济优选股票<br>A | 兴业数字经济优选股票<br>C |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 29,255,345.33   | 23,346,511.39   |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 743,028.58      | 5,613,928.90    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 911,795.78      | 11,630,850.67   |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -               | -               |
| 报告期期末基金份额总额                   | 29,086,578.13   | 17,329,589.62   |

注：申购份额含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回份额含转换出及分级份额调减份额。

**§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**

单位：份

|                          | 兴业数字经济优选股票A   | 兴业数字经济优选股票C |
|--------------------------|---------------|-------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 14,435,569.24 | -           |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -             | -           |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -             | -           |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 14,435,569.24 | -           |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 49.63         | -           |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|-------|----------------|------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构    | 1              | 20240401-20240630      | 14,435,569.24 | -    | -    | 14,435,569.24 | 31.10% |

#### 产品特有风险

本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。如果该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性压力；同时，该等集中赎回将可能产生（1）份额净值尾差风险；（2）基金净值波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；（4）因基金资产净值低于5000万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。

注：上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予兴业数字经济优选股票型证券投资基金募集注册的文件

- (二) 《兴业数字经济优选股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《兴业数字经济优选股票型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

## 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。

网站：<http://www.cib-fund.com.cn>

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司

2024年07月19日