

兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：兴华基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月22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2024年1月1日起至2024年6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40

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	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12	投资组合报告附注	48
§ 8	基金份额持有人信息	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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的情况	49
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	50
§ 9	开放式基金份额变动	50
§ 10	重大事件揭示	50
10.1	基金份额持有人大会决议	50
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	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4	基金投资策略的改变	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8	其他重大事件	52
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12	备查文件目录	54
12.1	备查文件目录	54
12.2	存放地点	54
12.3	查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金	
基金简称	兴华消费精选 6 个月持有混合发起	
基金主代码	014750	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 25 日	
基金管理人	兴华基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	21,375,881.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分类基金的基金简称	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C
下属分类基金的交易代码	014750	014751
报告期末下属分类基金的份额总额	19,893,187.46 份	1,482,694.03 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，把握消费主题相关的行业投资机会，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>（一）大类资产配置策略；（二）股票投资策略：1. 消费主题的界定；2. 行业配置策略；3. 个股投资策略；（三）港股通标的股票投资策略；（四）存托凭证投资策略；（五）债券投资策略；（六）金融衍生品投资策略；（七）资产支持证券投资策略；（八）可转换债券和可交换债券投资策略；（九）融资业务的投资策略；（十）证券公司短期公司债券投资策略。</p> <p>今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。</p>
业绩比较基准	中证消费服务领先指数收益率*60%+中证港股通大消费主题指数收益率(使用估值汇率调整)*20%+中债综合全价(总值)指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		兴华基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	韩冰	韩鑫普
	联系电话	0532-80921021	0755-26951111
	电子邮箱	hanbing@xinghuafund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4000678815	95565
传真		0532-80921032	0755-82960794
注册地址		山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址		山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		266199	518000
法定代表人		张磊	霍达

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.xinghuafund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴华基金管理有限公司	山东省青岛市李沧区金水路 187 号 2 号楼 8 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

基金类别	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	报告期（2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-1,027,856.00	-140,981.44
本期利润	-2,703,391.16	-284,950.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1471	-0.1717
本期加权平均净值利润率	-17.54%	-20.69%

本期基金份额净值增长率	-17.48%	-17.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）	
期末可供分配利润	-5,138,666.48	-393,730.37
期末可供分配基金份额利润	-0.2583	-0.2656
期末基金资产净值	14,754,520.98	1,088,963.66
期末基金份额净值	0.7417	0.7344
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 6 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-25.83%	-26.56%

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）本报告所列示的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）期末可供分配利润采用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孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A

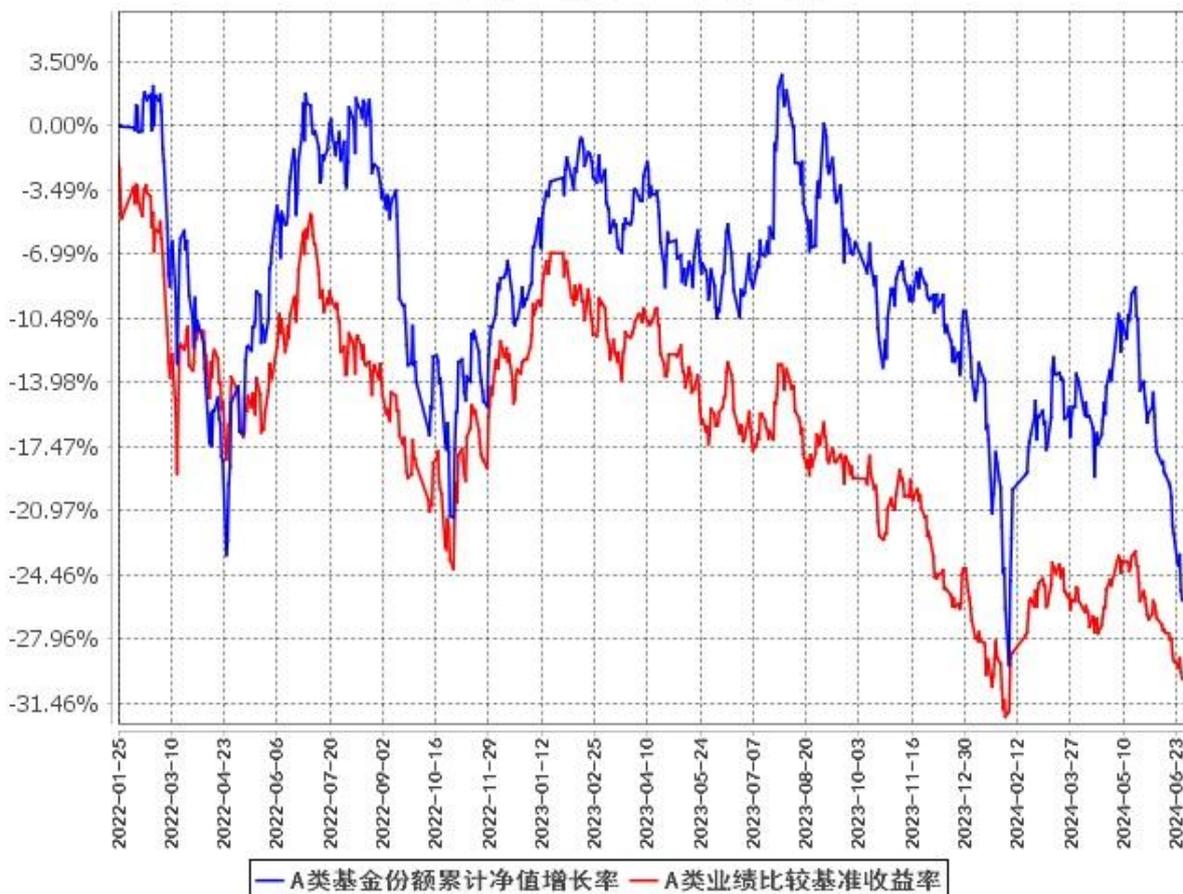
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-12.05%	0.91%	-4.40%	0.51%	-7.65%	0.40%
过去三个月	-12.41%	1.30%	-5.69%	0.71%	-6.72%	0.59%
过去六个月	-17.48%	1.60%	-7.89%	0.92%	-9.59%	0.68%
过去一年	-18.39%	1.40%	-15.78%	0.87%	-2.61%	0.53%
自基金合同生效起至今	-25.83%	1.40%	-30.12%	1.07%	4.29%	0.33%

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C

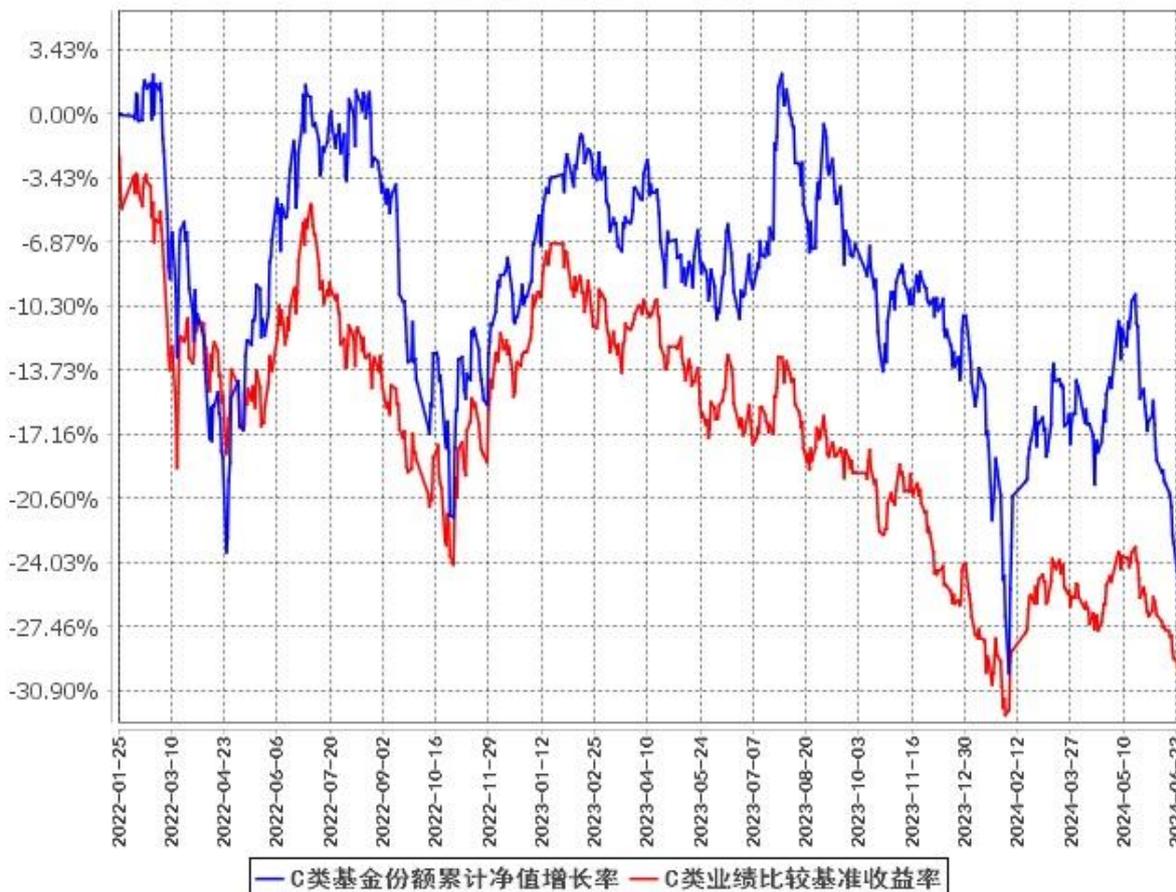
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-12.09%	0.90%	-4.40%	0.51%	-7.69%	0.39%
过去三个月	-12.50%	1.30%	-5.69%	0.71%	-6.81%	0.59%
过去六个月	-17.66%	1.60%	-7.89%	0.92%	-9.77%	0.68%
过去一年	-18.73%	1.40%	-15.78%	0.87%	-2.95%	0.53%
自基金合同生效起至今	-26.56%	1.40%	-30.12%	1.07%	3.56%	0.33%

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

A类基金份额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
(2022年1月25日至2024年6月30日)



C类基金份额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
(2022年1月25日至2024年6月30日)



注：(1) 本基金合同于 2022 年 1 月 25 日生效，截至本报告期末本基金合同生效已满一年。
(2) 按基金合同规定，本基金的建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合本基金合同的有关规定。

§ 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

兴华基金管理有限公司（以下简称“公司”）已于 2020 年 3 月 4 日正式获得中国证监会核准设立批复，2020 年 4 月 28 日取得营业执照，于 2020 年 9 月 14 日取得《经营证券期货业务许可证》。公司注册地及经营地为山东省青岛市，是一家全部由资深专业人士持股的公募基金管理公司，是注册在山东省的首家全国性公募基金管理公司，填补了山东公募基金业的空白，在山东金融发展史上具有里程碑意义。

截至 2024 年 6 月 30 日，兴华基金管理有限公司旗下共管理 9 只公募基金，包括兴华创新医疗

6 个月持有期混合型发起式证券投资基金、兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金、兴华安盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴华安恒纯债债券型证券投资基金、兴华安丰纯债债券型证券投资基金、兴华安悦纯债债券型证券投资基金、兴华安裕利率债债券型证券投资基金、兴华安聚纯债债券型证券投资基金、兴华安惠纯债债券型证券投资基金。

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		
崔涛	本基金的 基金经理	2023 年 6 月 6 日	-	7 年	崔涛先生，中国国籍，北京大学理学硕士，具有基金从业资格。曾任中信建投证券股份有限公司风控经理，永安财产保险股份有限公司研究员。2020 年 10 月加入兴华基金管理有限公司，历任投资研究部、权益研究部研究员，现任权益公募部基金经理。

注：（1）上述任职日期和离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

（2）证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

（3）本基金无基金经理助理。

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

无。

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》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，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，本基金运作合规，不存在违反基金合同和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，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》及《兴

华基金管理有限公司公平交易管理办法》，公平对待旗下管理的所有基金及其它组合。

本基金管理人通过统计检验的方法对本公司旗下管理的所有投资组合，在本报告期内不同时间窗口下(1 日内、3 日内、5 日内)同向交易的价差进行了专项分析。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下组合存在违反公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5%的情况，且未发现其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

本报告期内，股票市场的运行一波三折，期间振幅较大，且资产的涨跌表现在风格之间、行业之间分化较大，这样的市场环境对产品的投资运作构成了一定的挑战；指数表现方面，上证指数下跌 0.25%，消费服务指数下跌 10.89%，恒生指数上涨 3.94%，港股通大消费指数下跌 10.64%，无论 A 股还是港股，受制于疲软的内需环境，消费类资产均显著跑输市场大盘。

回顾本报告期，内需的复苏过程仍有反复，出口虽有极强的韧性，但贸易摩擦风险预期提升，叠加一些偶发性事件的冲击，权益市场的风险偏好始终较低。面临较大的不确定性，投资者更加偏好“大市值、低估值且经营预期稳定”的红利类资产，外加极少数有强业绩支持的景气板块，典型如 AI 板块里的算力方向，资金不断向这类资产聚集，已然成抱团之势，而其他类资产纷纷遭遇大幅下挫，不同资产类别之间的涨跌表现极其割裂，小微盘股更是在期间经历过若干次的流动性危机。

回顾本报告期的基金运作方面，基金跑输业绩比较基准，经过归因和反思，认为主要是因为：第一，低估了市场面临的不确定性，岁末年初进行大类资产配置的时候，较少考虑买入红利类的资产；第二，消费、医药和地产链是上半年的重灾区，这部分资产占据本基金相当大的仓位；第三，大市值行业龙头，买的较少，持仓的市值分布相对均匀，中小盘股票相对跑输。

感谢持有人的支持，您的信任是激励我们前进的最大动力，我们将继续勤勉尽责，努力进取，不忘初心，忠于所托，为信任奉献回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A 的基金份额净值为 0.7417 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.48%；截至本报告期末兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C 的基金份额净值

为0.7344元，本报告期基金份额净值增长率为-17.66%；同期业绩比较基准收益率为-7.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，出口方面依托于极具竞争力的制造能力，预计还将延续上半年靓丽的表现，而内需方面，预计宏观政策会加大力度托稳经济，正如刚刚结束的党的二十届三中全会所强调，要坚定不移实现全年经济社会发展目标，我们对下半年经济的平稳运行充满信心。尽管上半年市场的表现大幅低于我们的预期，我们对未来的投资运作仍然充满信心。这不仅仅是因为，中国股市的估值水平处在极低的位置，众多资产价格所隐含的或停滞或衰退的未来预期完全不符合我国经济当前的发展阶段以及具体行业的发展规律；更是因为，很多积极的变化正在静悄悄地发生，量变到质变，中国股市正在酝酿新一轮的大机会。我们认为，重要的积极变化有如下四个方面：第一，随着第三个“国九条”的发布与落实，中国资本市场的内在生态将发生积极的变化；第二，随着国内经济政策的转向以及国内外基本面趋势的强弱易位，加之本轮地产调整的底部特征逐渐明朗，资本市场的外在约束也在向积极的方向转变；第三，随着新质生产力的加速培育与突破，经济增长的新旧动能转换接近完成；第四，三中全会召开，新一轮的重大改革将进一步释放中国经济增长的潜力。

展望下半年，市场中枢抬升的空间还很充足，各个板块都有机会，落地到产品运作方面，我们将保持较高仓位水平，积极把握各个方向的投资机会，努力为投资者的信任奉献回报。

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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有产品估值委员会，产品估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算负责人、基金会计、监察稽核部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集产品估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，产品估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。产品估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、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，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查了本中期报告中的财务指标、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。

§ 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：兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,331,977.25	2,274,223.41
结算备付金		-	-

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	14,564,551.16	12,464,160.35
其中：股票投资		14,564,551.16	12,464,160.35
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		41,662.75	-
应收申购款		340.84	232.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		15,938,532.00	14,738,616.04
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
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		62,521.12	119,621.81
应付赎回款		-	1.77
应付管理人报酬		16,889.42	14,798.88
应付托管费		2,814.90	2,466.47
应付销售服务费		389.50	621.85
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	12,432.42	25,000.00
负债合计		95,047.36	162,510.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	21,375,881.49	16,232,640.04
未分配利润	6.4.7.8	-5,532,396.85	-1,656,534.78
净资产合计		15,843,484.64	14,576,105.26
负债和净资产总计		15,938,532.00	14,738,616.04

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 21,375,881.49 份，其中兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A 基金份额净值 0.7417 元，基金份额总额 19,893,187.46 份；兴华消费精选 6 个月持有

混合发起 C 基金份额净值 0.7344 元，基金份额总额 1,482,694.03 份。

6.2 利润表

会计主体：兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,856,957.67	665,302.43
1. 利息收入		6,884.15	4,427.97
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,884.15	4,427.97
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）		-1,044,337.22	-907,749.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,235,183.43	-1,055,134.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	190,846.21	147,384.54
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,819,504.60	1,568,624.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、营业总支出		131,384.37	171,062.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	99,507.86	131,060.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,584.62	21,843.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,735.66	3,276.91
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	12,556.23	14,881.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,988,342.04	494,239.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,988,342.04	494,239.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,988,342.04	494,239.61

6.3 净资产变动表

会计主体：兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	16,232,640.04	-	-1,656,534.78	14,576,105.26
二、本期期初净资产	16,232,640.04	-	-1,656,534.78	14,576,105.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,143,241.45	-	-3,875,862.07	1,267,379.38
（一）、综合收益总额	-	-	-2,988,342.04	-2,988,342.04
（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）	5,143,241.45	-	-887,520.03	4,255,721.42
其中：1. 基金申购款	6,143,104.25	-	-1,075,096.33	5,068,007.92
2. 基金赎回款	-999,862.80	-	187,576.30	-812,286.50

(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	21,375,881.49	-	-5,532,396.85	15,843,484.64
项目	上年度可比期间			
	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	22,399,920.03	-	-2,120,937.51	20,278,982.52
二、本期期初净资产	22,399,920.03	-	-2,120,937.51	20,278,982.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,999,502.94	-	616,019.55	-5,383,483.39
(一)、综合收益总额	-	-	494,239.61	494,239.61
(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)	-5,999,502.94	-	121,779.94	-5,877,723.00
其中：1. 基金申购款	474,607.88	-	-18,222.59	456,385.29
2. 基金赎回款	-6,474,110.82	-	140,002.53	-6,334,108.29
(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	16,400,417.09	-	-1,504,917.96	14,895,499.13

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：

韩光华	何美劲	阴利佳
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

兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]4077 号《关于准予兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由兴华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式发起式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 21,609,316.80 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0100 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 1 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 21,611,690.33 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,373.53 份基金份额。本基金的基金管理人为兴华基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,000,450.05 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》和《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同类别:在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的为 A 类基金份额;在投资者认购/申购基金时不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

对于每笔基金份额,6 个月持有期起始日指基金合同生效日(对认购份额而言)或该基金份额申购申请确认日(对申购份额而言)。对于每笔基金份额,6 个月持有期到期日指该基金份额 6 个月持有期起始日 6 个月后的月度对应日。在基金份额的 6 个月持有期到期日前(不含当日),基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回申请。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、地方政府债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、证券公司短期公司债券、可转换

债券(含分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、金融衍生品(包括股指期货、国债期货、股票期权)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)。本基金可根据相关法律法规和《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定,参与融资业务。本基金的投资组合比例为:本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%(其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%);其中投资于本基金所界定的消费主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权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%的现金或者到期日在一年期以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证消费服务领先指数收益率 \times 60%+中证港股通大消费主题指数收益率(使用估值汇率调整) \times 20%+中债综合全价(总值)指数收益率 \times 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人兴华基金管理有限公司于 2024 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。对基金从上市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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	271,397.91
等于：本金	271,275.72
加：应计利息	122.19
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	1,060,579.34
等于：本金	1,060,408.97
加：应计利息	170.37
减：坏账准备	-
合计	1,331,977.25

注：其他存款为本基金存放在开立于证券公司的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	17,012,657.45	-	14,564,551.16	-2,448,106.29
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	17,012,657.45	-	14,564,551.16	-2,448,106.29

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

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	12,432.42
合计	12,432.42

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,169,028.79	14,169,028.79
本期申购	6,137,742.62	6,137,742.62
本期赎回（以“-”号填列）	-413,583.95	-413,583.95
本期末	19,893,187.46	19,893,187.46

金额单位：人民币元

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,063,611.25	2,063,611.25
本期申购	5,361.63	5,361.63
本期赎回（以“-”号填列）	-586,278.85	-586,278.85
本期末	1,482,694.03	1,482,694.03

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-975,389.35	-457,992.61	-1,433,381.96
本期期初	-975,389.35	-457,992.61	-1,433,381.96
本期利润	-1,027,856.00	-1,675,535.16	-2,703,391.16
本期基金份额交易产生的变动数	-801,594.06	-200,299.30	-1,001,893.36
其中：基金申购款	-855,717.52	-218,384.84	-1,074,102.36
基金赎回款	54,123.46	18,085.54	72,209.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,804,839.41	-2,333,827.07	-5,138,666.48

单位：人民币元

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-155,901.32	-67,251.50	-223,152.82
本期期初	-155,901.32	-67,251.50	-223,152.82
本期利润	-140,981.44	-143,969.44	-284,950.88
本期基金份额交易产生的变动数	76,294.46	38,078.87	114,373.33
其中：基金申购款	-718.73	-275.24	-993.97
基金赎回款	77,013.19	38,354.11	115,367.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-220,588.30	-173,142.07	-393,730.37

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,419.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,464.95
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	6,884.15

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 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,235,183.43
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	-1,235,183.43

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 2024年1月1日 至2024年6月30日
卖出股票成交总额	85,086,450.42
减：卖出股票成本总额	86,212,373.39
减：交易费用	109,260.46
买卖股票差价收入	-1,235,183.43

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	190,846.21
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	190,846.21

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,819,504.60
——股票投资	-1,819,504.60
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,819,504.60

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年6月30日
审计费用	12,432.42
信息披露费	-
证券出借违约金	-
港股通证券组合费	123.81
合计	12,556.23

6.4.7.20 分部报告

无。

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，本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大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
兴华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
张磊	基金管理人的股东
韩光华	基金管理人的股东
宿迁信仁企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信智企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信忠企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信礼企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信勇企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
宿迁信良企业管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
青岛信爱投资中心（有限合伙）	基金管理人的股东

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 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券股份有限公司	-	-	9,472,585.00	13.31%

注：本基金本报告期未通过关联方进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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
合计	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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
招商证券股份有限公司	4,049.90	31.24%	-	-

注：本基金本报告期无应支付关联方佣金。

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 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	99,507.86	131,060.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,779.86	23,949.10
应支付基金管理人的净管理费	85,728.00	107,111.82

注：(1) 支付基金管理人兴华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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 × 1.20% / 当年天数。

(2) 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管

理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,584.62	21,843.51

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	合计
兴华基金管理有限公司	0.00	1.82	1.82
招商证券股份有限公司	0.00	1,081.39	1,081.39
合计	0.00	1,083.21	1,083.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	合计
兴华基金管理有限公司	0.00	1.81	1.81
招商证券股份有限公司	0.00	1,500.08	1,500.08
合计	0.00	1,501.89	1,501.89

注：（1）本基金 C 类基金份额销售服务费年费率为 0.4%，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日 C 类基金销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

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与关联方进行转融通证券出借业务。

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与关联方进行转融通证券出借业务。

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

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 6 月 30 日	
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C
基金合同生效日（2022 年 1 月 25 日）持有的基金份额	10,000,450.05	0.00
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	0.00
报告期间申购/买入总份额	6,058,309.47	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	16,058,759.52	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	80.72%	0.00%

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 6 月 30 日	
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C
基金合同生效日（2022 年 1 月 25 日）持有的基金份额	10,000,450.05	0.00
报告期初持有的基金份额	10,000,450.05	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,000,450.05	0.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	68.64%	0.00%
---------------------	--------	-------

注：基金管理人兴华基金管理有限公司投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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

兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A				
关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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
张磊	110.75	0.00%	110.75	0.00%
韩光华	4,330.15	0.02%	4,330.15	0.03%

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
招商证券股份有限公司	271,673.80	3,419.48	458,623.30	2,507.02

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商，上述款项包括本基金由基金托管人招商证券股份有限公司保管的银行存款以及证券交易结算资金，分别存放在具有基金托管资格的银行和基金托管人专用的证券账户，按银行同业利率或协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间没有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

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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。

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。

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转融通证券出借业务余额。

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

本基金为偏股混合型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

本基金管理人通过建立行之有效的风险管理体系和风险管理制度，充分揭示各类风险，并采取有效措施将风险管理控制在合理水平，保证基金投资业务稳健运行，保障公司发展战略和经营目标得以实现。公司的风险管理体系由公司董事会、监事、风险控制委员会、经营管理层、风险管理委员会、督察长、监察稽核部共同组成，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。

公司的各个部门作为各项工作的执行者，是所在部门风险的防范者，各部门风险管理的第一责任人，履行一线风险管理职能。各业务部门均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准。

为保障风险管理体系的持续性和有效性，保证风险管理目标得到全面实现，公司制定了可操作的风险管理程序，包括：风险识别、风险评估、风险报告、风险控制等环节。公司定期对风险、风险控制措施及执行情况进行总结，不断提高防范和化解各项风险的能力，不断完善各项内部控制措施，提高风险控制水平。

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可能产生的损失。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。本基金的银行存款存放于具有基金托管资格的交通银行股份有限公司，其他存款存放于中信建投证券股份有限公司及招商证券股份有限公司，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，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2024年6月30日，本基金未持有债券和资产支持证券投资。

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。

于2024年6月30日，本基金所承担的全部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运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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上市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%。于2024年6月30日，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。于2024年6月30日，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；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货币资金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 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	1,331,977.25	-	-	-	1,331,977.25
交易性金融资产	-	-	-	14,564,551.16	14,564,551.16
应收股利	-	-	-	41,662.75	41,662.75
应收申购款	-	-	-	340.84	340.84
资产总计	1,331,977.25	-	-	14,606,554.75	15,938,532.00
负债					
应付清算款	-	-	-	62,521.12	62,521.12
应付管理人报酬	-	-	-	16,889.42	16,889.42
应付托管费	-	-	-	2,814.90	2,814.90
应付销售服务费	-	-	-	389.50	389.50
其他负债	-	-	-	12,432.42	12,432.42
负债总计	-	-	-	95,047.36	95,047.36
利率敏感度缺口	1,331,977.25	-	-	14,511,507.39	15,843,484.64
上年度末 2023 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	2,274,223.41	-	-	-	2,274,223.41
交易性金融资产	-	-	-	12,464,160.35	12,464,160.35

应收申购款	-	-	-	232.28	232.28
资产总计	2,274,223.41	-	-	12,464,392.63	14,738,616.04
负债					
应付清算款	-	-	-	119,621.81	119,621.81
应付赎回款	-	-	-	1.77	1.77
应付管理人报酬	-	-	-	14,798.88	14,798.88
应付托管费	-	-	-	2,466.47	2,466.47
应付销售服务费	-	-	-	621.85	621.85
其他负债	-	-	-	25,000.00	25,000.00
负债总计	-	-	-	162,510.78	162,510.78
利率敏感度缺口	2,274,223.41	-	-	12,301,881.85	14,576,105.26

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

本基金本报告期末未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,556,116.16	-	3,556,116.16
资产合计	-	3,556,116.16	-	3,556,116.16
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,556,116.16	-	3,556,116.16

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	867, 225. 35	-	867, 225. 35
资产合计	-	867, 225. 35	-	867, 225. 35
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	867, 225. 35	-	867, 225. 35

6. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币升值 5%	177, 805. 81	43, 361. 27
港币相对人民币贬值 5%	-177, 805. 81	-43, 361. 27	

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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%），其中投资于本基金所界定的消费主题相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权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%的现金或者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、应收申购款等。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，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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	14,564,551.16	91.93	12,464,160.35	85.51
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	14,564,551.16	91.93	12,464,160.35	85.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%		585,552.32
2. 业绩比较基准下降 5%		-585,552.32	-322,891.72

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	14,564,551.16	12,464,160.35
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	14,564,551.16	12,464,160.35

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。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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	14,564,551.16	91.38
	其中：股票	14,564,551.16	91.38
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	1,331,977.25	8.36
8	其他各项资产	42,003.59	0.26
9	合计	15,938,532.00	100.00

注：（1）本基金报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 3,556,116.16 元，占期末基金资产净值的比例为 22.45%。

（2）由于四舍五入的原因，报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	9,020,255.00	56.93
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	333,000.00	2.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	631,000.00	3.98
L	租赁和商务服务业	903,280.00	5.70

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	120,900.00	0.76
S	综合	-	-
	合计	11,008,435.00	69.48

注：由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	2,328,000.26	14.69
C 消费者常用品	209,231.89	1.32
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	636,539.54	4.02
G 工业	66,443.10	0.42
H 信息技术	-	-
I 电信服务	315,901.37	1.99
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	3,556,116.16	22.45

注：以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	01368	特步国际	215,000	943,848.02	5.96
2	300662	科锐国际	56,000	903,280.00	5.70
3	603801	志邦家居	68,000	889,440.00	5.61
4	002572	索菲亚	52,000	797,160.00	5.03
5	601058	赛轮轮胎	47,000	658,000.00	4.15
6	603208	江山欧派	33,000	631,620.00	3.99
7	002612	朗姿股份	45,200	624,664.00	3.94
8	603833	欧派家居	10,700	573,092.00	3.62
9	601500	通用股份	87,000	464,580.00	2.93
10	01585	雅迪控股	48,000	432,391.28	2.73
11	03690	美团-W	4,200	425,874.74	2.69
12	600702	舍得酒业	7,500	425,025.00	2.68

13	002906	华阳集团	14,000	374,640.00	2.36
14	002035	华帝股份	60,000	373,800.00	2.36
15	00013	和黄医药	14,000	351,381.80	2.22
16	002332	仙琚制药	30,000	342,300.00	2.16
17	002810	山东赫达	28,000	329,840.00	2.08
18	603529	爱玛科技	12,000	327,960.00	2.07
19	600325	华发股份	50,000	325,000.00	2.05
20	002011	盾安环境	33,000	324,390.00	2.05
21	02015	理想汽车-W	5,000	320,807.02	2.02
22	01024	快手-W	7,500	315,901.37	1.99
23	002984	森麒麟	13,000	313,170.00	1.98
24	601966	玲珑轮胎	17,000	312,290.00	1.97
25	300791	仙乐健康	12,220	307,944.00	1.94
26	600383	金地集团	90,000	306,000.00	1.93
27	600779	水井坊	8,000	301,040.00	1.90
28	02359	药明康德	10,700	285,157.74	1.80
29	300973	立高食品	10,000	280,900.00	1.77
30	02367	巨子生物	5,000	209,231.89	1.32
31	300661	圣邦股份	2,500	206,950.00	1.31
32	09896	名创优品	6,000	205,079.20	1.29
33	002230	科大讯飞	4,000	171,800.00	1.08
34	603816	顾家家居	5,000	161,450.00	1.02
35	300418	昆仑万维	5,000	161,200.00	1.02
36	002739	万达电影	10,000	120,900.00	0.76
37	02285	泉峰控股	4,000	66,443.10	0.42

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	603801	志邦家居	3,356,530.00	23.03
2	300662	科锐国际	3,301,960.00	22.65
3	603208	江山欧派	3,259,254.00	22.36
4	601500	通用股份	2,301,358.00	15.79
5	600702	舍得酒业	2,283,924.00	15.67
6	600325	华发股份	2,130,788.00	14.62
7	002840	华统股份	2,114,458.00	14.51
8	000568	泸州老窖	2,005,391.00	13.76
9	002244	滨江集团	1,792,174.00	12.30
10	600754	锦江酒店	1,592,604.00	10.93

11	600779	水井坊	1,431,543.00	9.82
12	600975	新五丰	1,400,940.00	9.61
13	603112	华翔股份	1,400,917.00	9.61
14	300791	仙乐健康	1,371,721.00	9.41
15	02359	药明康德	1,339,037.15	9.19
16	02015	理想汽车-W	1,334,074.64	9.15
17	000933	神火股份	1,296,680.00	8.90
18	000526	学大教育	1,295,509.00	8.89
19	603816	顾家家居	1,258,458.00	8.63
20	601966	玲珑轮胎	1,211,184.00	8.31
21	603369	今世缘	1,161,002.00	7.97
22	03690	美团-W	1,151,358.50	7.90
23	300783	三只松鼠	1,112,107.00	7.63
24	601872	招商轮船	1,107,322.00	7.60
25	002599	盛通股份	1,101,277.00	7.56
26	603259	药明康德	1,090,460.00	7.48
27	00013	和黄医药	1,082,587.83	7.43
28	300972	万辰集团	1,063,727.00	7.30
29	002612	朗姿股份	1,051,374.00	7.21
30	603215	比依股份	1,040,341.75	7.14
31	002714	牧原股份	986,072.00	6.76
32	001979	招商蛇口	970,330.00	6.66
33	002810	山东赫达	957,483.00	6.57
34	01801	信达生物	948,502.20	6.51
35	09926	康方生物	925,133.75	6.35
36	688766	普冉股份	920,234.61	6.31
37	002572	索菲亚	918,420.00	6.30
38	002674	兴业科技	899,315.00	6.17
39	000560	我爱我家	891,283.00	6.11
40	01585	雅迪控股	886,485.51	6.08
41	688111	金山办公	828,132.00	5.68
42	688507	索辰科技	817,468.83	5.61
43	603833	欧派家居	786,603.00	5.40
44	000799	酒鬼酒	762,418.00	5.23
45	603600	永艺股份	738,965.00	5.07
46	002567	唐人神	732,201.00	5.02
47	01368	特步国际	724,202.30	4.97
48	01024	快手-W	717,135.30	4.92
49	601058	赛轮轮胎	679,150.00	4.66
50	600872	中炬高新	657,389.00	4.51
51	002035	华帝股份	657,330.00	4.51
52	688169	石头科技	639,739.73	4.39
53	01361	361度	626,952.36	4.30

54	002906	华阳集团	606,602.00	4.16
55	601168	西部矿业	601,886.00	4.13
56	603993	洛阳钼业	590,200.00	4.05
57	300666	江丰电子	578,842.00	3.97
58	688072	拓荆科技	572,765.10	3.93
59	600199	金种子酒	569,800.00	3.91
60	300378	鼎捷软件	553,268.00	3.80
61	301345	涛涛车业	551,451.00	3.78
62	600383	金地集团	545,830.00	3.74
63	03347	泰格医药	544,381.81	3.73
64	002011	盾安环境	524,952.00	3.60
65	002984	森麒麟	502,797.00	3.45
66	300496	中科创达	490,133.00	3.36
67	603755	日辰股份	452,976.00	3.11
68	601600	中国铝业	449,230.00	3.08
69	688035	德邦科技	421,458.25	2.89
70	300911	亿田智能	417,439.00	2.86
71	000048	京基智农	408,682.00	2.80
72	605050	福然德	408,555.00	2.80
73	603997	继峰股份	403,746.00	2.77
74	603128	华贸物流	394,935.00	2.71
75	06160	百济神州	391,395.12	2.69
76	000887	中鼎股份	390,790.00	2.68
77	600415	小商品城	389,489.00	2.67
78	603529	爱玛科技	378,584.00	2.60
79	601598	中国外运	372,600.00	2.56
80	300973	立高食品	371,934.00	2.55
81	02331	李宁	367,902.72	2.52
82	600200	江苏吴中	366,815.00	2.52
83	002555	三七互娱	365,181.00	2.51
84	688008	澜起科技	359,612.00	2.47
85	603711	香飘飘	359,004.00	2.46
86	09979	绿城管理控股	355,056.36	2.44
87	002332	仙琚制药	348,276.00	2.39
88	300687	赛意信息	346,345.00	2.38
89	300896	爱美客	338,644.00	2.32
90	688012	中微公司	334,764.00	2.30
91	002475	立讯精密	310,321.00	2.13
92	603848	好太太	296,557.00	2.03
93	00981	中芯国际	296,262.01	2.03
94	002384	东山精密	292,230.00	2.00

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	300662	科锐国际	2,451,703.00	16.82
2	603208	江山欧派	2,422,861.00	16.62
3	603801	志邦家居	2,364,794.94	16.22
4	000568	泸州老窖	2,238,625.00	15.36
5	002244	滨江集团	2,058,683.00	14.12
6	002840	华统股份	2,025,749.00	13.90
7	603112	华翔股份	1,992,195.00	13.67
8	600975	新五丰	1,980,496.00	13.59
9	603816	顾家家居	1,852,865.00	12.71
10	601500	通用股份	1,831,700.00	12.57
11	600325	华发股份	1,796,415.00	12.32
12	600702	舍得酒业	1,691,629.00	11.61
13	603215	比依股份	1,652,637.25	11.34
14	600754	锦江酒店	1,556,250.00	10.68
15	002674	兴业科技	1,367,261.00	9.38
16	000526	学大教育	1,333,331.00	9.15
17	000933	神火股份	1,296,286.00	8.89
18	600779	水井坊	1,234,419.00	8.47
19	300783	三只松鼠	1,158,582.00	7.95
20	603369	今世缘	1,141,432.00	7.83
21	002714	牧原股份	1,114,624.00	7.65
22	002599	盛通股份	1,110,388.00	7.62
23	601872	招商轮船	1,106,662.00	7.59
24	300791	仙乐健康	1,087,040.00	7.46
25	300972	万辰集团	1,056,628.00	7.25
26	002555	三七互娱	1,006,152.00	6.90
27	688766	普冉股份	956,095.00	6.56
28	601966	玲珑轮胎	952,186.00	6.53
29	002011	盾安环境	947,189.00	6.50
30	01801	信达生物	946,449.76	6.49
31	603259	药明康德	933,727.00	6.41
32	000560	我爱我家	914,200.00	6.27
33	001979	招商蛇口	913,104.00	6.26
34	600872	中炬高新	886,245.00	6.08
35	002810	山东赫达	846,641.00	5.81
36	09926	康方生物	844,491.87	5.79
37	688111	金山办公	825,407.44	5.66
38	002705	新宝股份	811,706.00	5.57

39	03690	美团-W	806,194.93	5.53
40	300378	鼎捷软件	804,648.00	5.52
41	02359	药明康德	791,909.29	5.43
42	02015	理想汽车-W	786,440.65	5.40
43	603128	华贸物流	767,276.00	5.26
44	00013	和黄医药	763,400.73	5.24
45	000799	酒鬼酒	760,323.00	5.22
46	688507	索辰科技	737,091.42	5.06
47	603600	永艺股份	715,152.00	4.91
48	002567	唐人神	687,940.00	4.72
49	01368	特步国际	685,237.94	4.70
50	002612	朗姿股份	668,978.00	4.59
51	688169	石头科技	662,499.50	4.55
52	01361	361度	660,159.60	4.53
53	601168	西部矿业	656,881.00	4.51
54	301345	涛涛车业	627,860.00	4.31
55	03347	泰格医药	600,887.92	4.12
56	601598	中国外运	587,235.00	4.03
57	603786	科博达	586,196.00	4.02
58	603993	洛阳钼业	580,278.00	3.98
59	300666	江丰电子	569,688.00	3.91
60	688072	拓荆科技	569,662.16	3.91
61	600809	山西汾酒	554,024.00	3.80
62	603444	吉比特	542,869.00	3.72
63	000048	京基智农	538,290.00	3.69
64	600519	贵州茅台	499,479.00	3.43
65	300496	中科创达	497,870.00	3.42
66	600199	金种子酒	496,232.00	3.40
67	603755	日辰股份	491,595.00	3.37
68	601600	中国铝业	463,350.00	3.18
69	605007	五洲特纸	460,120.00	3.16
70	600415	小商品城	459,500.00	3.15
71	688331	荣昌生物	459,404.92	3.15
72	688035	德邦科技	441,767.80	3.03
73	002384	东山精密	440,496.00	3.02
74	601799	星宇股份	432,948.00	2.97
75	300911	亿田智能	428,317.00	2.94
76	06160	百济神州	426,766.25	2.93
77	603997	继峰股份	405,000.00	2.78
78	02331	李宁	399,501.34	2.74
79	605050	福然德	398,534.00	2.73
80	000887	中鼎股份	393,300.00	2.70
81	688008	澜起科技	386,183.74	2.65

82	603711	香飘飘	384,100.00	2.64
83	600200	江苏吴中	374,400.00	2.57
84	01024	快手-W	361,348.41	2.48
85	300687	赛意信息	353,089.00	2.42
86	300896	爱美客	346,000.00	2.37
87	09979	绿城管理控股	345,848.01	2.37
88	688012	中微公司	342,976.36	2.35
89	00981	中芯国际	318,023.09	2.18
90	002475	立讯精密	306,700.00	2.10
91	01585	雅迪控股	293,259.31	2.01

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	90,132,268.80
卖出股票收入（成交）总额	85,086,450.42

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末参与股指期货投资。

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

本基金本报告期末未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本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

本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	41,662.75
4	应收利息	-
5	应收申购款	340.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,003.59

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 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

份额类别	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
兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	341	58,337.79	16,058,759.52	80.72%	3,834,427.94	19.28%
兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	208	7,128.34	0.00	0.00%	1,482,694.03	100.00%
合计	527	40,561.44	16,058,759.52	75.13%	5,317,121.97	24.87%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	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	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	143,622.47	0.7220%
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	2,015.64	0.1359%
	合计	145,638.11	0.6813%

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的情况

项目	份额类别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	0~10
	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	0

	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C	0
	合计	0

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员，基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数据区间为 0~10 万份；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数据区间为 0。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.05	46.78%	10,000,450.05	46.78%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,450.05	46.78%	10,000,450.05	46.78%	三年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 A	兴华消费精选 6 个月持有混合发起 C
基金合同生效日（2022 年 1 月 25 日）基金份额总额	18,578,225.77	3,033,464.56
本报告期期初基金份额总额	14,169,028.79	2,063,611.25
本报告期基金总申购份额	6,137,742.62	5,361.63
减：本报告期基金总赎回份额	413,583.95	586,278.85
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	19,893,187.46	1,482,694.03

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期末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

本报告期基金管理人、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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

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

本报告期本基金的管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期本基金的托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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	
中信建投证券股份有限公司	3	175,218,719.22	100.00%	36,443.21	100.00%	
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	

注：(1) 报告期内新增中信建投证券股份有限公司北交所交易单元，无退租交易单元。

(2) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- ①经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- ②具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- ③具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

(3) 基金交易单元的选择程序如下：

- ①本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- ②基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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

本基金未使用所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	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 1 月 22 日
2	兴华基金管理有限公司关于运用固有资金投资公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 2 月 23 日
3	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 3 月 29 日
4	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2024 年 4 月 22 日
5	兴华基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 5 月 8 日
6	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新（2024 年 6 月更新）	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 7 日
7	兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新（2024 年 6 月更新）	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 7 日
8	兴华基金管理有限公司关于济南分公司负责人变更的公告	中国证监会规定媒介	2024 年 6 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101-20240630	10,000,450.05	6,058,309.47	0.00	16,058,759.52	75.13%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

(1) 本基金对每份基金份额设置 6 个月持有期。在基金份额的 6 个月持有期到期日前（不含当日），投资者将面临因不能赎回基金份额而出现的流动性约束。

(2) 本基金为发起式基金，《基金合同》生效满 3 年之日（指自然日），若基金资产净值低于 2 亿元，无需召开基金持有人大会审议，基金合同应当终止，且不得通过召开基金持有人大会的方式延续。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

(3) 净值大幅波动的风险
由于本基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该机构投资者大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。

(4) 出现巨额赎回的风险
该机构投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。其他投资者的赎回申请也可能同时面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。

(5) 基金规模过小的风险
根据基金合同的约定，基金合同生效满 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。机构投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续 60 个工作日低于 5,000 万元情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金注册的批复
- 2、《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《兴华消费精选 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

兴华基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日