

# 东兴数字经济混合型发起式证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月23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16日（基金合同生效日）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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56

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.....	56
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东兴数字经济混合型发起式证券投资基金	
基金简称	东兴数字经济混合发起	
基金主代码	020440	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年01月16日	
基金管理人	东兴基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,724,880.28份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴数字经济混合发起A	东兴数字经济混合发起C
下属分级基金的交易代码	020440	020441
报告期末下属分级基金的份额总额	13,487,636.24份	12,237,244.04份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，重点挖掘数字经济主题股票中的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金为混合型基金，投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略和债券投资策略等。其中资产配置策略用于确定大类资产配置比例以规避系统性风险，股票投资策略主要用于挖掘与数字经济主题相关的优质上市公司。</p> <p>1、资产配置策略 2、股票投资策略 3、债券投资策略</p> <p>本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理，力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好且发行人成长性良好的品种进行投资。</p> <p>4、存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的研究判断，进行存托凭证的投资。</p>

	5、其他金融工具投资策略 (1) 可转债和可交债投资策略 (2) 资产支持证券投资策略 (3) 国债期货投资策略 (4) 股指期货投资策略
业绩比较基准	中证数字经济主题指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

## 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		东兴基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李宛霖	张立学
	联系电话	400-670-1800	010-68858113
	电子邮箱	xxpl@dxamc.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-670-1800	95580
传真		010-83770122	010-68858120
注册地址		北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		100033	100808
法定代表人		牛南洁	刘建军

## 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文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dxamc.cn">http://www.dxamc.cn</a>
基金中期报告备置地点	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦

	B座15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 (2024年01月16日(基金合同生效日)-2024年06月30日)	
	东兴数字经济混合发起A	东兴数字经济混合发起C
本期已实现收益	-286,811.24	-963,224.62
本期利润	-307,128.98	-965,293.98
加权平均基金份额本期利润	-0.0239	-0.0779
本期加权平均净值利润率	-2.25%	-7.42%
本期基金份额净值增长率	0.35%	0.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-174,433.24	-163,818.68
期末可供分配基金份额利润	-0.0129	-0.0134
期末基金资产净值	13,534,375.36	12,274,177.82
期末基金份额净值	1.0035	1.0030
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.35%	0.30%

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、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的孰低数。

3、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。

4、本基金基金合同于2024年1月16日生效，本报告实际报告期为2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30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

东兴数字经济混合发起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	-0.78%	1.89%	-2.43%	1.02%	1.65%	0.87%
过去三个月	-13.55%	2.01%	-5.63%	1.14%	-7.92%	0.87%
自基金合同生效起至今	0.35%	2.37%	-1.20%	1.42%	1.55%	0.95%

东兴数字经济混合发起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	-0.79%	1.88%	-2.43%	1.02%	1.64%	0.86%
过去三个月	-13.58%	2.01%	-5.63%	1.14%	-7.95%	0.87%
自基金合同生效起至今	0.30%	2.37%	-1.20%	1.42%	1.50%	0.95%

注：本基金基金合同于2024年1月16日生效，截至本报告期末，本基金合同生效不满六个月。

#### 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

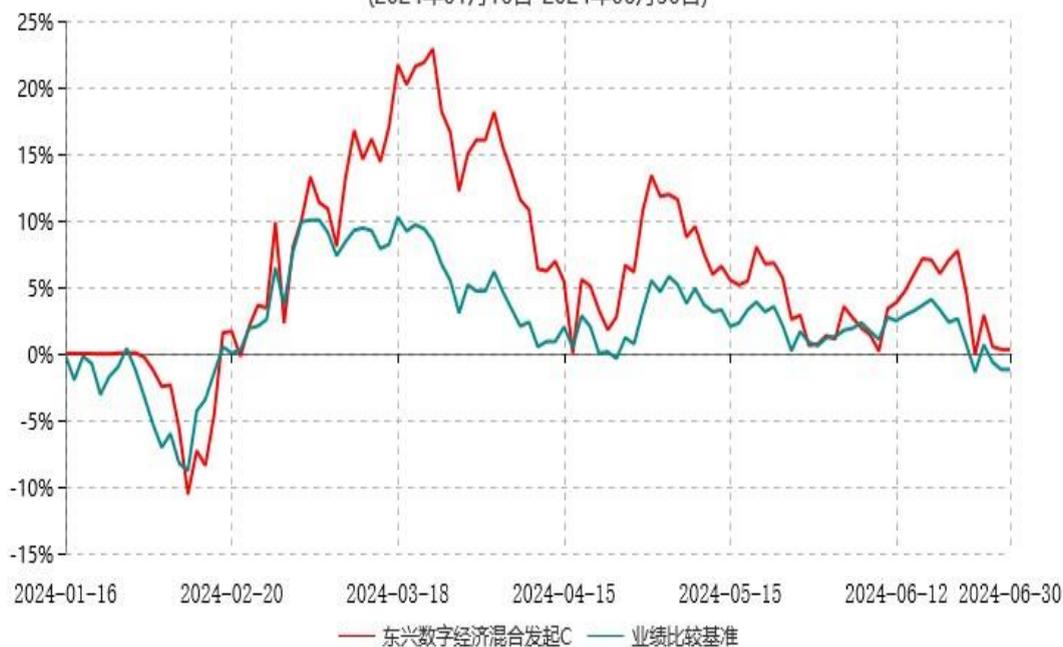
东兴数字经济混合发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024年01月16日-2024年06月30日)



东兴数字经济混合发起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

(2024年01月16日-2024年06月30日)



注：本基金基金合同生效日为2024年1月16日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内。截至本报告期末，本基金合同生效不满六个月，仍处于建仓期。

## §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

东兴基金管理有限公司（以下简称“东兴基金”）成立于2020年3月，注册地北京，注册资本2亿元。东兴证券股份有限公司（以下简称“东兴证券”）持有东兴基金100%股份，其控股股东为中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”），实际控制人为中国财政部。东兴基金系中国东方下属唯一公募基金业务经营主体，是中国东方金融服务平台的重要组成部分。

东兴基金前身为东兴证券基金业务部，先后在主动权益、固定收益、现金管理和指数类产品方面进行了大量布局，积累了丰富的投资运作经验：

特色指数类产品--在行业指数、量化增强方面进行深入研究设计，致力于打造特色精品指数类基金阵列；

主动管理类产品--以追求绝对收益为目标，贯彻自上而下和自下而上相结合的投研思路，坚持价值投资；

固定收益类产品--坚持守住价值、发现价值的原则，在严格把控信用风险的前提下，充分挖掘市场机会。

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司大部分员工来自于基金、券商、投资、信评等各类金融机构，90%以上员工具有硕士及以上学历。公司承载中国东方的红色基因，践行诚信、创新、激情、专注、协作的企业文化，坚持以投资者利益为上的原则，致力为客户持续创造价值。

截至2024年6月30日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金、东兴数字经济混合型发起式证券投资基金共19只开放式基金。

#### 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）	证券从业年限	说明

		期限			
		任职日期	离任日期		
周昊先生	本基金基金经理	2024-01-16	-	6年	毕业于北京有色金属研究总院材料科学与工程专业，博士研究生学历。2016年1月至2017年2月，任职中国有研科技集团有限公司；2017年3月至2018年1月，任职民生证券股份有限公司研究所研究员；2018年2月至2020年10月，任职国泰君安证券股份有限公司研究所研究员；2020年11月至2022年11月，任职泰康资产管理有限责任公司研究员；2022年11月至2023年7月，任职泰康基金管理有限公司权益投资部研究员；2023年7月至2023年10月，任职东兴基金管理有限公司权益投资部；2023年10月至今，任职东兴基金管理有限公司权益投资部基金经理。现任东兴数字经济混合型发起式证券投资基金基金经理。

注：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；对此后的非首任基金经理，"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》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴数字经济混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《东兴基金管理有限公司公平交易管理办法》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由分管投资的公司领导决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金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5%的情况。

## 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

今年1-2月份市场在流动性风险冲击下，市场大幅波动，随后2月中开始反弹。在宏观经济弱复苏背景下，市场在5月份开始加速轮动，整体波动依然较大，随后7月底海外以纳指、日经225大幅回调、进一步影响了A股投资者信心。

本基金投资方向在这半年，整体延续年初策略，主要配置在以TMT为代表的数字产业，涉及AI服务器、PCB、半导体设计、半导体设备、光模块、存储等，二季度本在半导体、消费电子等大周期底部、产业周期向上的领域配置更多，但是我们对单一产业链配置保持相对分散。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024年1月16日（基金合同生效日）起至2024年6月30日，本基金A类份额净值增长率为0.35%，业绩比较基准收益率为-1.20%，高于业绩比较基准1.55%；本基金C类份额净值增长率为0.30%，业绩比较基准收益率为-1.20%，高于业绩比较基准1.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们将继续优化组合，结合产业变化对组合进行进一步调整。本基金未来继续聚焦成长股，涉及行业包括电子、通信、计算机、传媒、新能源、军工、机械等，在投资过程我们聚焦优秀的上市公司，聚焦企业价值本身，关心产业和企业中长期成长性，力求组合能够获得可持续的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期内无基金持有人数或资产净值预警情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在东兴数字经济混合型发起式证券投资基金（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

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、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地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：东兴数字经济混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	1,419,889.65
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	24,411,990.96
其中：股票投资		24,411,990.96
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		-
应收申购款		64,362.79
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		25,896,243.40
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		427.00
应付赎回款		46,894.76
应付管理人报酬		25,966.18
应付托管费		4,327.70
应付销售服务费		1,028.33
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	9,046.25
负债合计		87,690.22
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	25,724,880.28
未分配利润	6.4.7.8	83,672.90
净资产合计		25,808,553.18

负债和净资产总计		25,896,243.40
----------	--	---------------

注：1、报告截止日2024年6月30日，东兴数字经济混合发起A基金份额净值1.0035元，基金份额总额13,487,636.24份，东兴数字经济混合发起C基金份额净值1.0030元，基金份额总额12,237,244.04份；

2、本基金基金合同于2024年1月16日生效，无上年度末和上年度可比期间数据。本报告实际报告期为2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日，下同。

## 6.2 利润表

会计主体：东兴数字经济混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日
一、营业总收入		-1,088,099.51
1.利息收入		14,965.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,965.09
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）		-1,155,985.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,189,726.41
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
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	33,740.65
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	-22,387.10

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	75,308.26
<b>减：二、营业总支出</b>		184,323.45
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	144,840.35
2.托管费	6.4.10.2.2	24,140.04
3.销售服务费	6.4.10.2.3	5,903.35
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	9,439.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,272,422.96
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,272,422.96
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,272,422.96

### 6.3 净资产变动表

会计主体：东兴数字经济混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年01月16日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	34,829,969.73	-	34,829,969.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,105,089.45	83,672.90	-9,021,416.55
（一）、综合收益总额	-	-1,272,422.96	-1,272,422.96
（二）、本期基金份额交易产生的净	-9,105,089.45	1,356,095.86	-7,748,993.59

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	18,533,614.24	2,478,297.74	21,011,911.98
2.基金赎回款	-27,638,703.69	-1,122,201.88	-28,760,905.57
（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	25,724,880.28	83,672.90	25,808,553.18

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：

牛南洁

黄言

王广辉

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

东兴数字经济混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2023年12月11日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴数字经济混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2023]2795号）的批复，自2024年1月2日至2024年1月12日公开募集设立。本基金为混合型发起式证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集34,825,507.85元人民币，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（2024）第0018号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴数字经济混合型发起式证券投资基金基金合同》于2024年1月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为34,829,969.73份，其中认购资金利息折合4,461.88份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴数字经济混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括股指期货、国债期货）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相关规定）。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：本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%；投资于数字经济主题的上市公司股票、存托凭证占非现金基金资产的比例不低于80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则--基本准则》（财政部令第33号发布、财政部令第76号修订）、于2006年2月15日及其后颁布和修订的42项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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XBRL模板第3号-年度报告和中期报告》、《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，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16日（基金合同生效日）至2024年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2024年1月16日（基金合同生效日）起至2024年6月30日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。在通常情况下，本基金所持有的金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。

基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资等金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的以摊余成本计量的、按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的票据、证券等金融资产所融出的资金分类为买入返售金融资产。

基金采用买入并持有至到期策略的金融资产，即到期日固定、回收金额固定或可确定，且有明确意图和能力持有至到期的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产，在债权投资中核算。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### 2、金融负债的分类

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及以摊余成本计量的金融负债两类。基金持有的未划分为以摊余成本计量的金融负债通常以公允价值计量且其变动计入当期损益，列示为交易性金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

分类为以摊余成本计量的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产利息收入。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入；买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本和对应投资品种产生的交易费用的差额确认。

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

①持有期间的利息收入：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产投资收益。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认投资收益；

②交易日按卖出金融资产交易日的成交总额扣除应结转的投资成本与应计利息(若有)和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认投资收益。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### （3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

##### （4）其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%的年费率逐日计提；  
(2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率逐日计提；  
(3) 根据基金合同，基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%的年费率计提；

(4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费用；基金份额持有人大会费用、基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；证券账户开户费用、银行账户维护费用、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为同一类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的该类基金份额净值转成相应类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《上海、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【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【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】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、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《财政部、国家税务总局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》及其他相关税务法规和实务操作、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》、财税【2023】39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，主要税项列示如下：

1.于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自2018年1月1日起，在基金运营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。

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。

3.对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起证券交易印花税实施减半征收。

6.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 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06月30日
活期存款	808,174.27
等于：本金	807,907.41
加：应计利息	266.86
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	611,715.38
等于：本金	611,691.96
加：应计利息	23.42
减：坏账准备	-
合计	1,419,889.65

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	24,434,378.06	-	24,411,990.96	-22,387.10
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	24,434,378.06	-	24,411,990.96	-22,387.10

#### 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通过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 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6.54
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	9,039.71
其他应付	-
合计	9,046.25

注：预提费用为按日计提的审计费。

**6.4.7.7 实收基金****6.4.7.7.1 东兴数字经济混合发起A**

金额单位：人民币元

项目 (东兴数字经济混合发起A)	本期 2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	12,110,491.33	12,110,491.33
本期申购	3,960,660.42	3,960,660.42
本期赎回（以“-”号填列）	-2,583,515.51	-2,583,515.51

本期末	13,487,636.24	13,487,636.24
-----	---------------	---------------

#### 6.4.7.7.2 东兴数字经济混合发起C

金额单位：人民币元

项目 (东兴数字经济混合发起C)	本期 2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	22,719,478.40	22,719,478.40
本期申购	14,572,953.82	14,572,953.82
本期赎回（以“-”号填列）	-25,055,188.18	-25,055,188.18
本期末	12,237,244.04	12,237,244.04

注：本基金基金合同于2024年1月16日生效，基金合同生效日的基金份额总额为34,829,969.73份，A类基金份额总额为12,110,491.33，其中：认购资金本金折算基金份额为：12,108,105.95份，利息折算基金份额为：2,385.38份；C类基金份额总额为22,719,478.40，其中：认购资金本金折算基金份额为：22,717,401.90份，利息折算基金份额为：2,076.50份。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 东兴数字经济混合发起A

单位：人民币元

项目 (东兴数字经济混合发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-286,811.24	-20,317.74	-307,128.98
本期基金份额交易产生的变动数	112,378.00	241,490.10	353,868.10
其中：基金申购款	238,747.44	334,463.65	573,211.09
基金赎回款	-126,369.44	-92,973.55	-219,342.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-174,433.24	221,172.36	46,739.12

## 6.4.7.8.2 东兴数字经济混合发起C

单位：人民币元

项目 (东兴数字经济混合发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-963,224.62	-2,069.36	-965,293.98
本期基金份额交易产生的变动数	799,405.94	202,821.82	1,002,227.76
其中：基金申购款	868,948.89	1,036,137.76	1,905,086.65
基金赎回款	-69,542.95	-833,315.94	-902,858.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-163,818.68	200,752.46	36,933.78

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日
活期存款利息收入	13,312.89
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,652.20
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	14,965.09

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金的利息收入。

## 6.4.7.10 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01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30

	日
卖出股票成交总额	265,288,017.78
减：卖出股票成本总额	265,895,041.21
减：交易费用	582,702.98
买卖股票差价收入	-1,189,726.41

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	33,740.65
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	33,740.65

#### 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01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-22,387.10
——股票投资	-22,387.10
——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	-22,387.10

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日
基金赎回费收入	74,559.49
转换费收入	748.77
合计	75,308.26

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日

审计费用	9,039.71
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他	400.00
合计	9,439.71

注：其他为证券账户开户费。

## 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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明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

本基金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
中国东方资产管理股份有限公司	基金管理人的实际控制人
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机构

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10.1 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01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	555,617,437.05	100.00%

注：本基金基金合同于2024年1月16日生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日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

本基金本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 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01月16日（基金合同生效日）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
东兴证券股份有限公司	444,494.06	100.00%	-	-

注：本基金基金合同于2024年1月16日生效，无上年度可比期间数据。

#### 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01月16日（基金合同生效日）至2024年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	144,840.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	43,565.07

应支付基金管理人的净管理费	101,275.28
---------------	------------

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同于2024年1月16日生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月16日（基金合同生效日）至2024年06月 30日		
	当期发生的基金应支付的托管费	24,140.04	

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同于2024年1月16日生效，无上年度可比期间数据。

#### 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01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东兴数字经济混合发起A	东兴数字经济混合发起C	合计

大连银行股份有限公司	-	3.33	3.33
东兴证券股份有限公司	-	2,438.72	2,438.72
合计	-	2,442.05	2,442.05

注：1、本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.10%的年费率计提。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

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

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初5个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同于2024年1月16日生效，无上年度可比期间数据。

#### 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2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日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2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日未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2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日未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

东兴数字经济混合发起A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月16日（基金合同生效日）

	至2024年06月30日
基金合同生效日（2024年01月16日）持有的基金份额	10,002,222.44
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,002,222.44
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	74.16%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用按招募说明书中规定的费率收取。

#### 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 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01月16日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	808,174.27	13,312.89

注：1、由中国邮政储蓄银行股份有限公司保管的银行存款为活期存款，利息收入为活期存款利息收入；

2、本基金基金合同于2024年1月16日生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日本基金无其他关联事项的说明。

#### **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**

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日未进行利润分配。

#### **6.4.12 期末（2024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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### **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**

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末未持有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**

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由风险控制委员会、投资决策委员会、风险管理部门组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

##### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本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，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末未持有债券。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末未持有同业存单。

### **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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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。

于2024年6月30日，本基金所承担的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(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**

本报告所称流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。基金管理人在报告期内综合考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，综合进行流动性风险管理。

基金管理人坚持按照“组合管理、分散投资”的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，通过灵活配置的二级市场投资策略、分散化的投资原则、严格的投资比例限制等投资安排，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,419,599.37	-	-	-	-	290.28	1,419,889.65
交易性金融资产	-	-	-	-	-	24,411,990.96	24,411,990.96
应收申购款	-	-	-	-	-	64,362.79	64,362.79
资产总计	1,419,599.37	-	-	-	-	24,476,644.03	25,896,243.40
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	427.00	427.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	46,894.76	46,894.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,966.18	25,966.18
应付托管费	-	-	-	-	-	4,327.70	4,327.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,028.33	1,028.33
其他负债	-	-	-	-	-	9,046.25	9,046.25
负债总计	-	-	-	-	-	87,690.22	87,690.22
利率敏感度缺口	1,419,599.37	-	-	-	-	24,388,953.81	25,808,553.18

注：1、表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

2、本基金基金合同生效日为2024年1月16日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

1、本报告期末，市场利率上升或下降25个基点，对本基金资产净值无重大影响。

2、本基金基金合同生效日为2024年1月16日，无上年度末数据。

#### 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

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 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06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	24,411,990.96	94.59
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	24,411,990.96	94.59

注：本基金基金合同生效日为2024年1月16日，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；	
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06月30日
	业绩比较基准变动+5%	1,680,365.98
	业绩比较基准变动-5%	-1,680,365.98

注：本基金基金合同生效日为2024年1月16日，无上年度末数据。

## 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06月30日
第一层次	24,411,990.96
第二层次	-
第三层次	-
合计	24,411,990.96

注：本基金基金合同生效日为2024年1月16日，无上年度末数据。

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

#### 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货币资金、应收申购款和其他应付款项，其账面价值与公允价值相若。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	24,411,990.96	94.27
	其中：股票	24,411,990.96	94.27
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	1,419,889.65	5.48
8	其他各项资产	64,362.79	0.25
9	合计	25,896,243.40	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	14,890,770.85	57.70
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	1,455,590.00	5.64
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	7,646,993.80	29.63
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	4,208.31	0.02
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	414,428.00	1.61
S	综合	-	-
	合计	24,411,990.96	94.59

### 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	002273	水晶光电	92,500	1,570,650.00	6.09
2	600487	亨通光电	99,200	1,564,384.00	6.06
3	300661	圣邦股份	18,740	1,551,297.20	6.01
4	300408	三环集团	53,000	1,547,070.00	5.99
5	002371	北方华创	4,800	1,535,472.00	5.95
6	601138	工业富联	55,300	1,515,220.00	5.87
7	300502	新易盛	14,100	1,488,255.00	5.77
8	300458	全志科技	62,000	1,457,620.00	5.65
9	301099	雅创电子	32,600	1,455,590.00	5.64
10	688099	晶晨股份	24,513	1,454,111.16	5.63
11	601728	中国电信	233,600	1,436,640.00	5.57
12	603893	瑞芯微	23,700	1,402,329.00	5.43
13	688018	乐鑫科技	13,718	1,353,692.24	5.25
14	688052	纳芯微	13,065	1,342,820.70	5.20
15	688484	南芯科技	34,759	1,289,558.90	5.00
16	688361	中科飞测	24,720	1,169,256.00	4.53

17	688368	晶丰明源	13,902	770,170.80	2.98
18	300133	华策影视	64,300	394,802.00	1.53
19	002947	恒铭达	1,100	38,720.00	0.15
20	001314	亿道信息	1,000	38,430.00	0.15
21	300788	中信出版	400	9,924.00	0.04
22	601801	皖新传媒	1,400	9,702.00	0.04
23	603160	汇顶科技	100	6,875.00	0.03
24	003019	宸展光电	205	5,192.65	0.02
25	688372	伟测科技	107	4,208.31	0.02

## 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	10,368,952.00	40.18
2	301099	雅创电子	9,592,912.70	37.17
3	300458	全志科技	7,499,296.30	29.06
4	688381	帝奥微	6,951,341.58	26.93
5	300308	中际旭创	6,662,717.00	25.82
6	300857	协创数据	6,597,906.00	25.56
7	001309	德明利	6,465,767.40	25.05
8	300394	天孚通信	6,317,016.00	24.48
9	601138	工业富联	6,314,604.00	24.47
10	002273	水晶光电	6,027,148.00	23.35
11	300476	胜宏科技	5,648,311.00	21.89
12	603236	移远通信	4,827,047.80	18.70
13	300364	中文在线	4,794,315.00	18.58
14	000628	高新发展	4,744,984.00	18.39
15	300661	圣邦股份	4,683,150.40	18.15
16	688141	杰华特	4,610,475.62	17.86

17	002916	深南电路	4,268,358.76	16.54
18	300781	因赛集团	4,206,119.00	16.30
19	603893	瑞芯微	3,897,501.00	15.10
20	002947	恒铭达	3,848,548.00	14.91
21	688183	生益电子	3,828,857.44	14.84
22	301236	软通动力	3,466,303.00	13.43
23	688362	甬矽电子	3,255,426.20	12.61
24	300624	万兴科技	3,217,236.00	12.47
25	300570	太辰光	3,202,490.00	12.41
26	300408	三环集团	3,054,505.00	11.84
27	002343	慈文传媒	2,973,664.20	11.52
28	688652	京仪装备	2,806,025.99	10.87
29	603283	赛腾股份	2,742,757.00	10.63
30	301171	易点天下	2,658,914.00	10.30
31	601595	上海电影	2,618,729.00	10.15
32	301205	联特科技	2,572,208.70	9.97
33	688099	晶晨股份	2,496,836.24	9.67
34	688167	炬光科技	2,462,654.23	9.54
35	300604	长川科技	2,458,968.00	9.53
36	300133	华策影视	2,456,310.00	9.52
37	688508	芯朋微	2,367,776.36	9.17
38	688601	力芯微	2,300,105.29	8.91
39	688018	乐鑫科技	2,238,371.91	8.67
40	688496	清越科技	2,234,008.01	8.66
41	688368	晶丰明源	2,200,594.13	8.53
42	002281	光迅科技	2,190,127.64	8.49
43	688798	艾为电子	2,164,463.50	8.39
44	688484	南芯科技	2,132,573.26	8.26
45	300327	中颖电子	2,112,273.00	8.18
46	001314	亿道信息	2,109,116.00	8.17
47	688052	纳芯微	2,069,208.56	8.02

48	688200	华峰测控	1,936,871.92	7.50
49	002636	金安国纪	1,837,035.00	7.12
50	600707	彩虹股份	1,798,134.00	6.97
51	300602	飞荣达	1,756,152.00	6.80
52	301051	信濠光电	1,743,439.00	6.76
53	688525	佰维存储	1,738,982.81	6.74
54	002938	鹏鼎控股	1,699,709.00	6.59
55	300433	蓝思科技	1,696,074.00	6.57
56	301217	铜冠铜箔	1,644,318.00	6.37
57	000977	浪潮信息	1,631,453.00	6.32
58	002236	大华股份	1,596,858.80	6.19
59	603986	兆易创新	1,588,340.00	6.15
60	688981	中芯国际	1,576,226.28	6.11
61	688519	南亚新材	1,569,150.37	6.08
62	688037	芯源微	1,559,412.12	6.04
63	600893	航发动力	1,556,574.00	6.03
64	600487	亨通光电	1,548,268.00	6.00
65	002371	北方华创	1,541,717.00	5.97
66	688536	思瑞浦	1,498,590.30	5.81
67	600373	中文传媒	1,498,167.00	5.80
68	002156	通富微电	1,497,987.00	5.80
69	601858	中国科传	1,497,698.08	5.80
70	301308	江波龙	1,496,426.00	5.80
71	002475	立讯精密	1,493,899.00	5.79
72	300594	朗进科技	1,488,955.00	5.77
73	601728	中国电信	1,429,632.00	5.54
74	688361	中科飞测	1,423,649.20	5.52
75	300684	中石科技	1,418,660.00	5.50
76	688143	长盈通	1,399,164.64	5.42
77	688498	源杰科技	1,392,997.28	5.40
78	002179	中航光电	1,331,608.50	5.16

79	300812	易天股份	1,315,356.00	5.10
80	688772	珠海冠宇	1,293,694.54	5.01
81	300654	世纪天鸿	1,287,135.00	4.99
82	300726	宏达电子	1,278,418.00	4.95
83	001330	博纳影业	1,223,480.00	4.74
84	000100	TCL科技	1,199,998.00	4.65
85	603738	泰晶科技	1,199,134.40	4.65
86	300373	扬杰科技	1,184,686.00	4.59
87	688045	必易微	1,180,716.31	4.57
88	688012	中微公司	1,176,694.70	4.56
89	688107	安路科技	1,143,463.69	4.43
90	688711	宏微科技	1,120,764.51	4.34
91	300707	威唐工业	1,098,476.00	4.26
92	300459	汤姆猫	1,098,312.00	4.26
93	688629	华丰科技	1,069,535.16	4.14
94	688256	寒武纪	1,059,396.40	4.10
95	300017	网宿科技	999,876.00	3.87
96	002463	沪电股份	999,346.00	3.87
97	300002	神州泰岳	999,100.00	3.87
98	003019	宸展光电	999,063.80	3.87
99	688375	国博电子	998,977.15	3.87
100	603496	恒为科技	998,717.00	3.87
101	601801	皖新传媒	998,651.00	3.87
102	601689	拓普集团	998,181.00	3.87
103	300395	菲利华	998,106.00	3.87
104	300788	中信出版	997,108.00	3.86
105	300296	利亚德	974,961.00	3.78
106	300496	中科创达	965,483.00	3.74
107	600435	北方导航	948,586.00	3.68
108	300413	芒果超媒	923,086.00	3.58
109	300442	润泽科技	922,453.00	3.57

110	002241	歌尔股份	898,528.00	3.48
111	688002	睿创微纳	895,291.61	3.47
112	600760	中航沈飞	890,636.00	3.45
113	600584	长电科技	870,298.00	3.37
114	301191	菲菱科思	821,452.00	3.18
115	688766	普冉股份	799,910.04	3.10
116	300315	掌趣科技	799,678.00	3.10
117	688252	天德钰	798,351.95	3.09
118	300081	恒信东方	798,152.00	3.09
119	300229	拓尔思	797,370.00	3.09
120	603516	淳中科技	797,055.00	3.09
121	688061	灿瑞科技	794,619.33	3.08
122	603019	中科曙光	788,760.00	3.06
123	688533	上声电子	779,863.29	3.02
124	300136	信维通信	698,517.00	2.71
125	605333	沪光股份	697,594.00	2.70
126	688233	神工股份	619,760.05	2.40
127	688372	伟测科技	599,709.82	2.32
128	300790	宇瞳光学	599,101.00	2.32
129	300731	科创新源	599,021.00	2.32
130	300693	盛弘股份	598,417.00	2.32
131	300757	罗博特科	579,210.00	2.24
132	603160	汇顶科技	525,155.00	2.03
133	600986	浙文互联	519,130.00	2.01

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、“买入金额”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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	9,381,452.00	36.35
2	301099	雅创电子	7,984,147.00	30.94
3	300308	中际旭创	7,040,124.00	27.28
4	300857	协创数据	6,964,944.00	26.99
5	300394	天孚通信	6,912,442.72	26.78
6	001309	德明利	6,688,763.60	25.92
7	688381	帝奥微	6,684,320.45	25.90
8	300458	全志科技	6,076,407.00	23.54
9	300476	胜宏科技	6,026,636.00	23.35
10	000628	高新发展	5,253,733.00	20.36
11	601138	工业富联	5,135,240.00	19.90
12	603236	移远通信	5,002,524.20	19.38
13	300364	中文在线	4,831,195.00	18.72
14	002916	深南电路	4,380,831.00	16.97
15	002273	水晶光电	4,341,523.00	16.82
16	688141	杰华特	4,315,969.27	16.72
17	688183	生益电子	3,866,759.64	14.98
18	301236	软通动力	3,734,670.02	14.47
19	002947	恒铭达	3,723,684.00	14.43
20	300781	因赛集团	3,542,432.00	13.73
21	300624	万兴科技	3,489,337.00	13.52
22	688362	甬矽电子	3,273,432.07	12.68
23	300661	圣邦股份	3,169,160.50	12.28
24	300570	太辰光	3,141,085.82	12.17
25	603283	赛腾股份	2,955,041.00	11.45
26	002343	慈文传媒	2,831,972.80	10.97
27	688652	京仪装备	2,722,244.69	10.55
28	603893	瑞芯微	2,555,389.00	9.90
29	688167	炬光科技	2,536,404.85	9.83
30	300604	长川科技	2,497,634.00	9.68

31	301205	联特科技	2,478,245.00	9.60
32	301171	易点天下	2,428,785.00	9.41
33	601595	上海电影	2,418,035.00	9.37
34	688508	芯朋微	2,361,299.95	9.15
35	688601	力芯微	2,165,923.23	8.39
36	002281	光迅科技	2,082,646.00	8.07
37	688798	艾为电子	2,047,518.55	7.93
38	300133	华策影视	2,027,104.00	7.85
39	300327	中颖电子	2,025,736.00	7.85
40	688496	清越科技	1,985,107.61	7.69
41	002938	鹏鼎控股	1,848,201.00	7.16
42	001314	亿道信息	1,835,403.00	7.11
43	688200	华峰测控	1,820,827.61	7.06
44	002636	金安国纪	1,702,789.00	6.60
45	600707	彩虹股份	1,684,699.00	6.53
46	300433	蓝思科技	1,682,981.00	6.52
47	300602	飞荣达	1,673,645.00	6.48
48	002156	通富微电	1,655,827.00	6.42
49	603986	兆易创新	1,631,760.00	6.32
50	301051	信濠光电	1,626,861.00	6.30
51	002236	大华股份	1,617,780.00	6.27
52	688981	中芯国际	1,607,467.60	6.23
53	688519	南亚新材	1,600,193.25	6.20
54	688525	佰维存储	1,564,354.68	6.06
55	301217	铜冠铜箔	1,560,569.00	6.05
56	000977	浪潮信息	1,556,566.00	6.03
57	600893	航发动力	1,541,667.00	5.97
58	300408	三环集团	1,532,823.00	5.94
59	300594	朗进科技	1,530,193.00	5.93
60	601858	中国科传	1,523,678.00	5.90
61	600373	中文传媒	1,491,343.00	5.78

62	688368	晶丰明源	1,484,189.35	5.75
63	688037	芯源微	1,482,728.10	5.75
64	002475	立讯精密	1,451,472.00	5.62
65	688536	思瑞浦	1,439,850.92	5.58
66	002179	中航光电	1,416,432.00	5.49
67	301308	江波龙	1,400,718.00	5.43
68	300684	中石科技	1,383,853.00	5.36
69	688498	源杰科技	1,344,844.64	5.21
70	300726	宏达电子	1,319,665.00	5.11
71	688143	长盈通	1,279,529.93	4.96
72	688772	珠海冠宇	1,277,358.41	4.95
73	688099	晶晨股份	1,240,653.19	4.81
74	603516	淳中科技	1,230,803.00	4.77
75	000100	TCL科技	1,227,776.00	4.76
76	300654	世纪天鸿	1,205,637.87	4.67
77	001330	博纳影业	1,200,798.00	4.65
78	300373	扬杰科技	1,170,997.00	4.54
79	603738	泰晶科技	1,161,945.00	4.50
80	300459	汤姆猫	1,121,073.00	4.34
81	688711	宏微科技	1,114,852.08	4.32
82	688012	中微公司	1,109,588.42	4.30
83	300707	威唐工业	1,094,978.00	4.24
84	688045	必易微	1,088,767.00	4.22
85	300296	利亚德	1,045,549.00	4.05
86	688629	华丰科技	1,044,066.91	4.05
87	300812	易天股份	1,032,951.00	4.00
88	002463	沪电股份	1,032,712.50	4.00
89	300017	网宿科技	1,031,304.00	4.00
90	003019	宸展光电	1,028,148.00	3.98
91	601801	皖新传媒	1,023,575.00	3.97
92	300002	神州泰岳	1,013,857.00	3.93

93	688256	寒武纪	1,009,334.52	3.91
94	688375	国博电子	1,007,808.13	3.90
95	688107	安路科技	990,490.53	3.84
96	300788	中信出版	982,700.00	3.81
97	300395	菲利华	970,819.00	3.76
98	688018	乐鑫科技	967,645.46	3.75
99	600584	长电科技	957,900.00	3.71
100	601689	拓普集团	949,163.00	3.68
101	603496	恒为科技	933,665.40	3.62
102	688766	普冉股份	932,655.18	3.61
103	688002	睿创微纳	898,893.79	3.48
104	600760	中航沈飞	898,532.00	3.48
105	002241	歌尔股份	885,033.40	3.43
106	688484	南芯科技	873,362.66	3.38
107	300496	中科创达	846,053.00	3.28
108	600435	北方导航	843,383.00	3.27
109	300413	芒果超媒	830,880.00	3.22
110	688252	天德钰	820,990.26	3.18
111	300229	拓尔思	801,468.00	3.11
112	300442	润泽科技	786,479.00	3.05
113	603019	中科曙光	775,001.00	3.00
114	301191	菲菱科思	774,961.00	3.00
115	688533	上声电子	768,170.04	2.98
116	688061	灿瑞科技	747,208.40	2.90
117	300315	掌趣科技	729,591.00	2.83
118	300136	信维通信	710,591.00	2.75
119	300081	恒信东方	645,121.00	2.50
120	605333	沪光股份	643,461.00	2.49
121	300757	罗博特科	636,182.00	2.47
122	688233	神工股份	608,525.66	2.36
123	688052	纳芯微	595,307.00	2.31

124	300790	宇瞳光学	582,337.00	2.26
125	300731	科创新源	569,394.00	2.21
126	688372	伟测科技	556,809.92	2.16
127	300693	盛弘股份	517,081.00	2.00

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	290,329,419.27
卖出股票收入（成交）总额	265,288,017.78

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“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**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**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**

本基金投资的前十名股票没有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	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	64,362.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,362.79

**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**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**§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
东兴数字经济混合发起A	186	72,514.17	10,002,222.44	74.16%	3,485,413.80	25.84%
东兴数字经济混合发起C	566	21,620.57	-	-	12,237,244.04	100.00%
合计	752	34,208.62	10,002,222.44	38.88%	15,722,657.84	61.12%

## 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	东兴数字经济混合发起A	46,063.00	0.34%
	东兴数字经济混合发起C	1,010,756.72	8.26%
	合计	1,056,819.72	4.11%

## 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	东兴数字经济混合发起A	0~10
	东兴数字经济混合发起C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东兴数字经济混合发起A	>100
	东兴数字经济混合发起C	0
	合计	>100

## 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	发起份额总数	发起份额占基金总	发起份额承诺持有

		份额比例		份额比例	期限
基金管理人固有资金	10,002,222.44	38.88%	10,002,222.44	38.88%	不低于三年
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	10,002,222.44	38.88%	10,002,222.44	38.88%	-

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴数字经济混合发起A	东兴数字经济混合发起C
基金合同生效日(2024年01月16日)基金份额总额	12,110,491.33	22,719,478.40
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	3,960,660.42	14,572,953.82
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	2,583,515.51	25,055,188.18
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	13,487,636.24	12,237,244.04

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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，基金管理人的重大人事变动：（1）经本公司股东2024年4月决定，鉴于本公司第一届董事会到期换届的具体情况，周利国先生、聂辉华先生、李秀兰女士不再担任本公司独立董事。本公司第二届董事会成员为牛南洁先生、刘亮先生、张锋先生、郝洁女士、刘天先生、刘煜辉先生、安保和先生、岳克胜先生；（2）经本公司股东2024年5月决定，刘煜辉先生不再担任本公司独立董事职务，同意聘任何帆先生为本公司独立董事；委派黄言先生担任本公司董事。

本报告期内，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，无涉及基金管理人、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

本报告期内基金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

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券股份有限公司	2	555,617,437.05	100.00%	444,494.06	100.00%	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务实力较强的证券公司参与证券交易。其中财务状况良好、经营行为规范指最近一年证券公司分类评级在 C 类或 C 类以上；合规风控能力是指证券公司近三年无重大违法违规行为、无正在接受立案调查，或受到监管机构严重处罚，责令改正逾期未改，影响正常经营等情形；交易、研究实力较强以公司交易部门、投资部门、研究部及投研分管领导的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：公司根据以上标准对不同证券公司进行考察、选择和确定。在满足证券公司选择标准的前提下，公司应当与提供证券交易服务的证券公司签订委托协议，

约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。证券公司的选择由研究部发起，由合规法律部对选择标准、选择程序是否符合法规及本制度规定进行初步合规审查后，报督察长进行合规性审查和总经理审批，公司与其建立合作关系并签署委托协议。

3、本基金本报告期内新增 2 个交易单元，分别为东兴证券股份有限公司上海交易所和深圳交易所交易单元各 1 个。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

## 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	东兴基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	指定网站	2024-01-15
2	东兴数字经济混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊、指定网站	2024-01-17
3	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2023年第四季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2024-01-19
4	东兴数字经济混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告	指定报刊、指定网站	2024-01-23
5	关于《东兴数字经济混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换转入业务的公告》的更正公告	指定报刊、指定网站	2024-01-24
6	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2023年年度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2024-03-29
7	东兴数字经济混合型发起式证券投资基金2024年第1季度报告	指定网站	2024-04-19
8	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2024年第一季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2024-04-19
9	东兴基金管理有限公司关于董事变更的公告	指定报刊、指定网站	2024-04-27
10	东兴基金管理有限公司关于董事变更的公告	指定报刊、指定网站	2024-05-24
11	东兴数字经济混合型发起式证券投资基金产品资料概要更新	指定网站	2024-06-19

## §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	2024年1月16日（基金合同生效日）-2024年6月30日	10,002,222.44	-	-	10,002,222.44	38.88%

产品特有风险

1、本基金为混合型基金，本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%，因此股票市场的变化将影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

2、本基金投资于数字经济主题的上市公司股票、存托凭证占非现金基金资产的比例不低于80%。该类股票的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险，其投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、市场需求变化、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个股价格表现低于预期的风险。因此，本基金所投资的数字经济主题相关的股票可能在一定时期内表现与其他未投资的证券不同，造成本基金的收益低于其他基金，或波动率高于其他基金或市场平均水平。此外，由于本基金还可以投资其它品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。

3、本基金的投资范围包括国债期货、股指期货。国债期货、股指期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损失的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

4、资产支持证券投资风险

本基金可投资于资产支持证券。资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

5、投资存托凭证的风险

本基金可投资存托凭证，存托凭证是指由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行、代表境外基础证券权益的证券。如本基金投资存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

6、与发起式基金运作方式相关的基金合同提前终止风险

本基金为发起式基金，《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续《基金合同》期限，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。因此，本基金存在《基金合同》提前终止的风险。

7、流动性风险评估

(1) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资标的均在相关法律法规及中国证监会规定的合法范围之内，且具备良好的可投资性和流动性。本基金的投资范围的设定合理、明确，操作性较强。本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%，投资于数字经济主题的上市公司股票、存托凭证占非现金基金资产的比例不低于80%。实际投资过程中，本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，重点挖掘数字经济主题股票中的投资机会，力争实现基金资产的长期稳健增值。根据《流动性风险管理规定》的相关要求，本基金审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

(2) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日某一类别的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

3) 暂停赎回：连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经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，并应当在规定媒介上进行公告。

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真、公告或通过销售机构告知等其他方式在3个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在规定媒介上刊登公告。

实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金运作过程中，将使用延期办理赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价、实施侧袋机制及中国证监会认定的其他措施控制流动性风险，具体使用情形及程序详见基金合同第六部分基金份额的申购与赎回、第十四部分基金资产估值。

1) 延期办理赎回申请、暂停接受赎回申请能够在巨额赎回时，因变现需求过大，市场交易量不足，导致证券不能低成本地转变为现金，进而对基金资产净值造成较大波动的情形，对基金份额持有人来说，存在不能及时赎回基金份额的风险。

2) 收取短期赎回费能够控制资金短期频繁的申购赎回，避免净值大幅的波动，维护净值稳定。

3) 当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，采取暂停基金估值，通过延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请等措施可避免基金份额净值虚高或虚低给申购、赎回客户或存量客户造成损失，对基金份额持有人来说，存在不能及时赎回基金份额的风险。

4) 通过摆动定价将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待，当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

5) 实施侧袋机制

投资人具体请参见招募说明书“侧袋机制”部分，详细了解本基金实施侧袋机制的情形及程序。

8、实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无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

- 一、中国证监会核准东兴数字经济混合型发起式证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴数字经济混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴数字经济混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴数字经济混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会颁发的经营证券期货业务许可证、营业执照、公司章程

### 12.2 存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，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。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.dxamc.cn](http://www.dxamc.cn)）查阅。

东兴基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十日