

德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：德邦基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 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	5
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遵规守信情况的说明	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
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	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	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58

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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金	
基金简称	德邦半导体产业混合发起式	
基金主代码	014319	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 28 日	
基金管理人	德邦基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,478,807,027.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	德邦半导体产业混合发起式 A	德邦半导体产业混合发起式 C
下属分级基金的交易代码	014319	014320
报告期末下属分级基金的份额总额	359,526,619.85 份	2,119,280,407.23 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，重点投资于半导体产业主题相关优质上市公司，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较债券市场、股票市场及现金类资产的收益风险特征，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。
业绩比较基准	中证全指半导体产品与设备指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*10%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资于港股通标的股票，需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	德邦基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张驥
	联系电话	021-26010886
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn
客户服务电话	4008217788	95528

传真	021-26010808	021-63602540
注册地址	上海市虹口区东大名路 501 号 503B 单元	上海市中山东一路 12 号
办公地址	上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	200010	200126
法定代表人	左畅	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www. dbfund. com. cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、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	德邦基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元

§ 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	德邦半导体产业混合发起式 A	德邦半导体产业混合发起式 C
本期已实现收益	21, 309, 127. 13	130, 117, 480. 93
本期利润	24, 677, 824. 17	149, 039, 667. 47
加权平均基金份额本期利润	0. 1459	0. 1382
本期加权平均净值利润率	14. 15%	13. 44%
本期基金份额净值增长率	43. 16%	42. 87%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	-93, 255, 478. 55	-560, 172, 398. 89
期末可供分配基金份额利润	-0. 2594	-0. 2643

期末基金资产净值	389,979,797.34	2,285,698,389.98
期末基金份额净值	1.0847	1.0785
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	8.47%	7.85%

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（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦半导体产业混合发起式 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	-4.86%	2.39%	-3.68%	1.16%	-1.18%	1.23%
过去三个月	9.34%	2.78%	-5.71%	1.51%	15.05%	1.27%
过去六个月	43.16%	2.48%	7.12%	1.38%	36.04%	1.10%
过去一年	33.81%	2.42%	-7.35%	1.42%	41.16%	1.00%
自基金合同生效起至今	8.47%	2.25%	-21.03%	1.52%	29.50%	0.73%

德邦半导体产业混合发起式 C

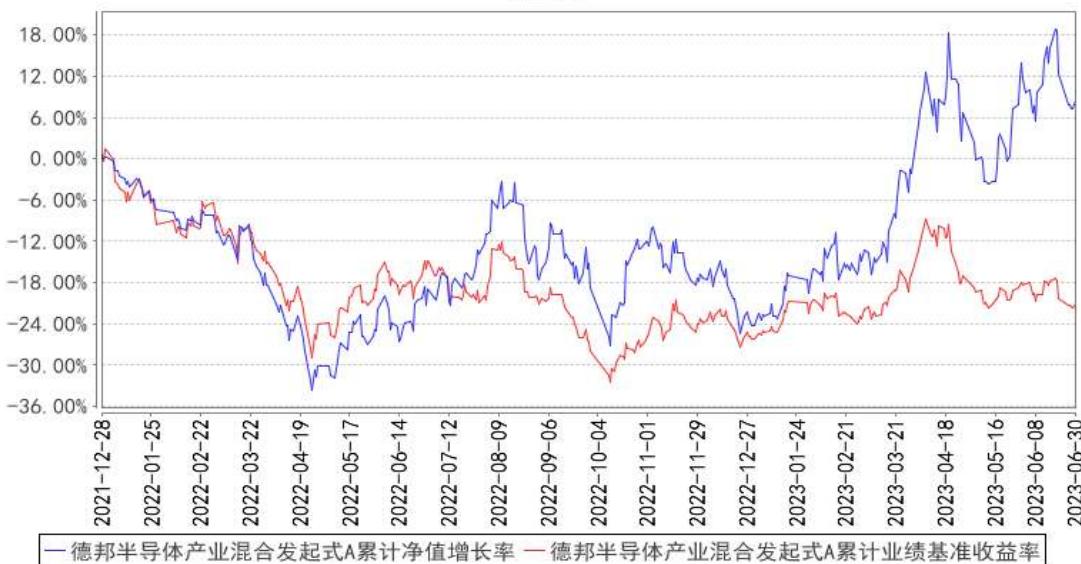
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.89%	2.39%	-3.68%	1.16%	-1.21%	1.23%
过去三个月	9.24%	2.78%	-5.71%	1.51%	14.95%	1.27%
过去六个月	42.87%	2.48%	7.12%	1.38%	35.75%	1.10%
过去一年	33.31%	2.42%	-7.35%	1.42%	40.66%	1.00%

自基金合同生效起至今	7.85%	2.25%	-21.03%	1.52%	28.88%	0.73%
------------	-------	-------	---------	-------	--------	-------

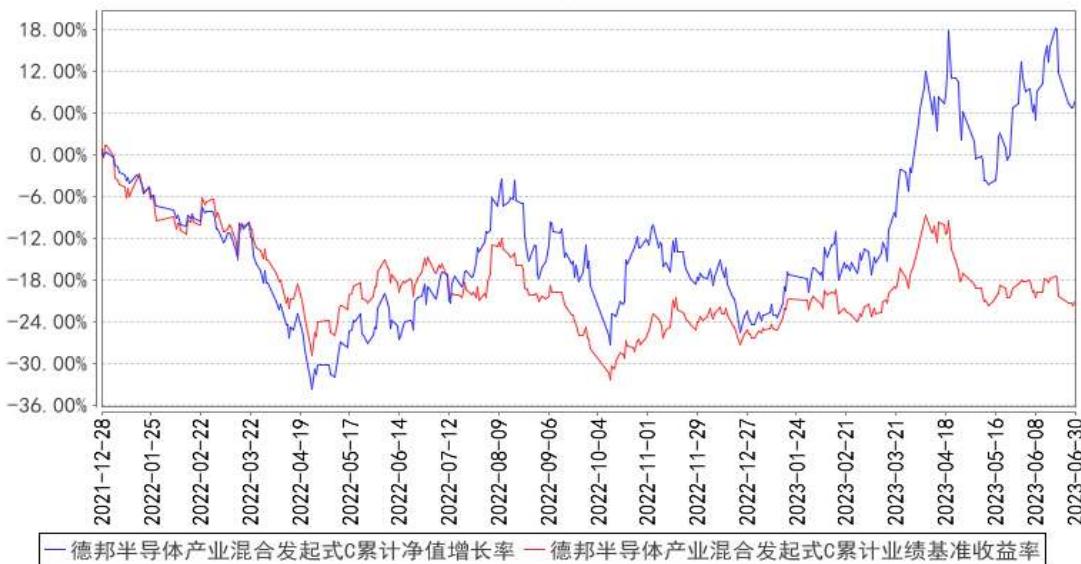
注：本基金业绩比较基准：中证全指半导体产品与设备指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*10%+中证全债指数收益率*20%

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

德邦半导体产业混合发起式A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



德邦半导体产业混合发起式C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



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 12 月 28 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2021 年 12 月 28 日至 2023 年 06 月 30 日。

§ 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

德邦基金管理有限公司经中国证监会（证监许可[2012]249号）批准，于2012年3月27日正式成立。股东为德邦证券股份有限公司、西子联合控股有限公司、浙江省土产畜产进出口集团有限公司，注册资本为5.9亿元人民币。公司以坦诚、高效、公平、有爱、创新、进取、担当、共赢为企业文化，以市场需求为导向，以客户服务为中心，以创造价值为目标，为客户成就财富梦想，为股东实现利润回报，为员工搭建发展平台，为社会履行企业责任。

截止2023年6月30日，本基金管理人共管理三十二只开放式基金：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦民裕进取量化精选灵活配置混合型证券投资基金、德邦乐享生活混合型证券投资基金、德邦新添利债券型证券投资基金、德邦锐兴债券型证券投资基金、德邦景颐债券型证券投资基金、德邦锐乾债券型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、德邦如意货币市场基金、德邦锐泓债券型证券投资基金、德邦短债债券型证券投资基金、德邦德瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、德邦锐恒39个月定期开放债券型证券投资基金、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、德邦大消费混合型证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金、德邦锐泽86个月定期开放债券型证券投资基金、德邦科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、德邦沪港深龙头混合型证券投资基金、德邦锐裕利率债债券型证券投资基金、德邦安顺混合型证券投资基金、德邦上证G60创新综合指数增强型发起式证券投资基金、德邦价值优选混合型证券投资基金、德邦周期精选混合型发起式证券投资基金、德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金、德邦港股通成长精选混合型证券投资基金。

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		
雷涛	本基金的 基金经理	2021年 12月28 日	-	7年	硕士，毕业于上海交通大学控制理论与控制工程专业。曾任职于华为技术有限公司，华安证券研究员，德邦证券高级研究总监。2021年6月调入德邦基金，现任德邦半导体产业混合型发起式证券投资

					基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
吴昊	本基金的基金经理	2021 年 12 月 28 日	-	13 年	博士, 2010 年 3 月至 2012 年 7 月担任国联证券股份有限公司研究所分析师; 2012 年 7 月至 2015 年 2 月担任天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、基金助理; 2015 年 2 月至 2017 年 7 月担任天治基金管理有限公司权益投资部基金经理。2017 年 8 月加入德邦基金管理有限公司, 现任德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金的基金经理。

注: 1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日; 若该基金经理自基金合同生效日起即任职, 则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定, 以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内, 基金运作合法合规, 无损害基金份额持有人利益的行为, 基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度规定, 对投资交易行为进行监察稽核, 从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关, 借助 IT 系统和人工监控等方式在各个环节严格控制交易公平执行; 通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进, 确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内, 公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析, 并对连续两个季度期间内、不同时间窗口下(日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析, 未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发现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

今年上半年中证半导体涨幅为 8.85%，排名靠近中间位置。上半年行情呈现出一季度上涨，二季度回落之后一直处于振荡过程中。

我们维持今年半导体行情三个驱动力的判断：1. 全球半导体周期的拐点；2. 国产替代的进一步深入；3. 人工智能的技术浪潮，带来半导体产业的新需求。上半年，国产替代和人工智能的驱动力已经有了一定的表现，我们认为这两个驱动力带来的行情仍然没有结束。后面，将会进一步呈现结构性的机会。而半导体周期的演绎，上半年的行情体现的相对较少，后续随着不同的产品拐点的出现，市场也会对应出现相关的行情表现。整个下半年，半导体行情的主要驱动力将来自半导体周期的机会，再叠加 AI 和国产替代两个部分的结构性机会。

我们的配置思路仍然依据投资框架来展开，即不断的评估各个细分领域基本面的边际变化，选择最有持续性，空间最大的细分领域进行配置。当前，我们看好存储、算力、封测、设备材料等领域，同时对消费类芯片保持巨大的关注。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末德邦半导体产业混合发起式 A 基金份额净值为 1.0847 元，基金份额净值增长率为 43.16%，同期业绩比较基准收益率为 7.12%；德邦半导体产业混合发起式 C 基金份额净值为 1.0785 元，基金份额净值增长率为 42.87%，同期业绩比较基准收益率为 7.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对全球宏观经济的复苏仍然保持乐观，经济的复苏将对半导体周期的拐点出现有重要的支撑。市场对半导体产业的周期拐点的来临，预期出现多次的退后。但是随着时间的推移，全球半导体周期的拐点仍然是在逐步的临近。我们相信，这次的周期拐点，将会出现斜率不高，但是确定性很强的特点。对应的行情也会随着不同的品类的拐点出现，而有相应的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《德邦基金管理有限公司基金估值业务管理制度》、《德邦基金管理有限公司估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。估值委员会主要由公司分管运营的副总经理、分管投资的副总经理或投资总监、督察长、投资研究条线负责人、基金经理（或投资经理）、基金运营部、监察稽核部代表及风险控制

人员等组成。估值委员会主要负责根据相关法律法规及公司章程，拟定公司的估值政策、估值原则，确定估值程序、流程、职责分工并提出估值意见；对投资品种需要提供特殊定价时，研究相关估值政策和估值模型，提供和评估估值技术；在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，制定投资品种采用的相关估值模型、假设及参数；评价估值用外部信息的客观性和可靠程度；保证基金估值的公允性，维护基金持有人的利益；监督估值政策、估值程序及估值调整的执行情况等。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的会计准则、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，确定证券投资基金的份额净值。经托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

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

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款规定。

根据本基金合同的规定，该基金生效之日起三年后的对应日，若基金资产规模低于 2 亿元，基金合同终止。

§ 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在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

本报告期内,由德邦基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	215,092,097.64	17,170,131.74
结算备付金		11,611,505.95	2,747,718.22
存出保证金		778,347.86	165,796.36
交易性金融资产	6.4.7.2	2,487,567,131.41	175,285,581.91
其中：股票投资		2,487,567,131.41	175,285,581.91
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	—	—
债权投资	6.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	6.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—	—
应收清算款		2,497,599.94	1,022,290.12
应收股利		—	—
应收申购款		93,013,792.78	1,170,483.62
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	48.63	—
资产总计		2,810,560,524.21	197,562,001.97
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		54, 749, 427. 95	-
应付赎回款		68, 633, 762. 43	6, 685, 491. 26
应付管理人报酬		3, 441, 397. 49	253, 852. 68
应付托管费		573, 566. 23	42, 308. 77
应付销售服务费		793, 082. 41	54, 462. 69
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. 9	6, 691, 100. 38	1, 172, 429. 20
负债合计		134, 882, 336. 89	8, 208, 544. 60
净资产：			
实收基金	6. 4. 7. 10	2, 478, 807, 027. 08	250, 647, 586. 46
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	196, 871, 160. 24	-61, 294, 129. 09
净资产合计		2, 675, 678, 187. 32	189, 353, 457. 37
负债和净资产总计		2, 810, 560, 524. 21	197, 562, 001. 97

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，德邦半导体产业混合发起式 A 基金份额净值 1.0847 元，基金份额总额 359, 526, 619. 85 份；德邦半导体产业混合发起式 C 基金份额净值 1.0785 元，基金份额总额 2, 119, 280, 407. 23 份。德邦半导体产业混合发起式份额总额合计 2, 478, 807, 027. 08 份。

6. 2 利润表

会计主体：德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业收入		187, 061, 721. 79	-2, 149, 522. 77
1. 利息收入		290, 376. 93	11, 267. 63
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	290, 376. 93	7, 662. 36
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		-	3, 605. 27
证券出借利息收 入		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”号填列）		146,033,114.39	-3,096,788.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	140,153,703.09	-3,116,378.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	5,879,411.30	19,590.47
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	22,290,883.58	906,245.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	18,447,346.89	29,752.13
减：二、营业总支出		13,344,230.15	179,993.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,483,346.59	90,285.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,580,557.81	15,047.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,185,127.66	2,063.96
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	95,198.09	72,596.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		173,717,491.64	-2,329,515.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		173,717,491.64	-2,329,515.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		173,717,491.64	-2,329,515.86

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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(基金净值)	250,647,586.46	-	-61,294,129.09	189,353,457.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	250,647,586.46	-	-61,294,129.09	189,353,457.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,228,159,440.62	-	258,165,289.33	2,486,324,729.95
(一)、综合收益总额	-	-	173,717,491.64	173,717,491.64
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	2,228,159,440.62	-	84,447,797.69	2,312,607,238.31
其中：1.基金申购款	6,802,499,249.36	-	302,429,265.41	7,104,928,514.77
2.基金赎回款	-4,574,339,808.74	-	-217,981,467.72	-4,792,321,276.46
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,478,807,027.08	-	196,871,160.24	2,675,678,187.32
项目	上年度可比期间			

	2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	14,278,877.60	-	38,172.54	14,317,050.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	14,278,877.60	-	38,172.54	14,317,050.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	6,565,347.79	-	-3,996,714.82	2,568,632.97
(一)、综合收益总额	-	-	-2,329,515.86	-2,329,515.86
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	6,565,347.79	-	-1,667,198.96	4,898,148.83
其中：1. 基金申购款	13,642,480.74	-	-3,122,837.64	10,519,643.10
2. 基金赎回款	-7,077,132.95	-	1,455,638.68	-5,621,494.27
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	20,844,225.39	-	-3,958,542.28	16,885,683.11

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：

张驥

洪双龙

洪双龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3539号文《关于准予德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由基金管理人德邦基金管理有限公司于2021年12月20日起至2021年12月24日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资并出具安永华明(2021)验字第60982868_B07号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2021年12月28日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币14278785.82元,在募集期间产生利息91.78元,折合14278877.60份基金份额。本基金的基金管理人为德邦基金管理有限公司,注册登记机构为德邦基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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(含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债))、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货、信用衍生品、债券回购、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)、货币市场工具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。

本基金的业绩比较基准为:中证全指半导体产品与设备指数收益率*70%+中证港股通综合指数收益率*10%+中证全债指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第

3号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

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。

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

本基金本报告期无重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推进营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

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》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资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；持股期限超过1年的，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	215,092,097.64
等于：本金	215,063,237.36
加：应计利息	28,860.28
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-

其他存款	
等于：本金	
加：应计利息	
减：坏账准备	
合计	215,092,097.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,477,306,396.32	-	2,487,567,131.41	10,260,735.09
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	2,477,306,396.32	-	2,487,567,131.41	10,260,735.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

注：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

注：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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末不存在按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末
	2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	48.63
待摊费用	-
合计	48.63

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,081.70
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,597,758.53
其中：交易所市场	6,597,758.53
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	29,752.78
应付信息披露费	59,507.37

合计	6,691,100.38
----	--------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

德邦半导体产业混合发起式 A

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	48,364,144.82	48,364,144.82
本期申购	635,780,022.42	635,780,022.42
本期赎回(以“-”号填列)	-324,617,547.39	-324,617,547.39
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	359,526,619.85	359,526,619.85

德邦半导体产业混合发起式 C

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	202,283,441.64	202,283,441.64
本期申购	6,166,719,226.94	6,166,719,226.94
本期赎回(以“-”号填列)	-4,249,722,261.35	-4,249,722,261.35
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	2,119,280,407.23	2,119,280,407.23

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

德邦半导体产业混合发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,652,364.18	3,936,029.26	-11,716,334.92
本期利润	21,309,127.13	3,368,697.04	24,677,824.17
本期基金份额交易产生的变动数	-98,912,241.50	116,403,929.74	17,491,688.24
其中：基金申购款	-201,677,859.54	237,640,569.10	35,962,709.56
基金赎回款	102,765,618.04	-121,236,639.36	-18,471,021.32
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-93,255,478.55	123,708,656.04	30,453,177.49
-----	----------------	----------------	---------------

德邦半导体产业混合发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-66,011,785.76	16,433,991.59	-49,577,794.17
本期利润	130,117,480.93	18,922,186.54	149,039,667.47
本期基金份额交易产生的变动数	-624,278,094.06	691,234,203.51	66,956,109.45
其中：基金申购款	-1,994,029,426.31	2,260,495,982.16	266,466,555.85
基金赎回款	1,369,751,332.25	-1,569,261,778.65	-199,510,446.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-560,172,398.89	726,590,381.64	166,417,982.75

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	230,186.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	56,146.69
其他	4,043.55
合计	290,376.93

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	140,153,703.09
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	140,153,703.09

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	4,838,487,189.51
减：卖出股票成本总额	4,683,993,792.55
减：交易费用	14,339,693.87

买卖股票差价收入	140,153,703.09
----------	----------------

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,879,411.30
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	5,879,411.30

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	22,290,883.58
股票投资	22,290,883.58
债券投资	—
资产支持证券投资	—
基金投资	—
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	22,290,883.58

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	18,428,749.51
基金转换费收入	18,597.38
合计	18,447,346.89

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	5,937.94
合计	95,198.09

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生与本基金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。

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
德邦基金管理有限公司（“德邦基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
德邦证券股份有限公司（“德邦证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

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		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	占当期股票成交总额的比例 (%)	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	占当期股票成交总额的比例 (%)
德邦证券	454,591,576.13	3.85	134,450,589.04	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
德邦证券	-	-	4,500,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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 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 (%)
德邦证券	332,440.08	3.88	195,858.97	2.97
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	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 (%)
德邦证券	98,323.58	100.00	53,941.29	100.00

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,483,346.59	90,285.30
其中：支付销售机构的客户维护 费	3,679,183.18	29,702.55

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,580,557.81	15,047.58

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

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		
	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		
	德邦半导体产业混合发 起式 A	德邦半导体产业混合发 起式 C	合计
德邦基金	-	124,411.23	124,411.23
德邦证券	-	161.44	161.44
合计	-	124,572.67	124,572.67
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦半导体产业混合发 起式 A	德邦半导体产业混合发 起式 C	合计
德邦基金	-	1.39	1.39
合计	-	1.39	1.39

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，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年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	德邦半导体产业混合发起式 A	德邦半导体产业混合发起式 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 28 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.7814%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	德邦半导体产业混合发起式 A	德邦半导体产业混合发起式 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 28 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-

额		
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	47.9700%	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
浦发银行	215,092,097.64	230,186.69	1,253,518.17	6,977.98

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生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

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未发生其它关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西	2023年3	6个月	新股	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

	能 源	月 31 日		流 通 受 限						
001287	中 电 港	2023 年 3 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.88	21.02	828	9,836.64	17,404.56	-
001324	长 青 科 技	2023 年 5 月 12 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001360	南 矿 集 团	2023 年 3 月 31 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海 森 药 业	2023 年 3 月 30 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华 纬 科 技	2023 年 5 月 9 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中 科 磁 业	2023 年 3 月 27 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301170	锡 南 科 技	2023 年 6 月 16 日	6 个 月	新 股 流 通	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-

				受限						
301203	国泰环保	2023年3月28日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6 个月	新股流通受限	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6 个月	新股流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1-6 个月(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1-6 个月(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301305	朗坤	2023年5	6 个月	新股	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-

	环境	月 15 日		流通受限						
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通	73.45	46.64	70	5,141.50	3,264.80	-

				受限						
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-

301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月 (含)	新股未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1-6 个月 (含)	新股未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,841	12,113.78	13,954.78	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	689	7,138.04	8,157.76	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通	11.66	12.26	547	6,378.02	6,706.22	-

				受限						
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	594	10,573.20	10,626.66	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	513	18,544.95	19,560.69	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	4,751	94,354.86	85,803.06	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-

688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,551	18,767.10	18,720.57	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	415	11,063.90	13,072.50	-
688435	英方软件	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	38.66	73.03	2,244	86,753.04	163,879.32	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯	2023 年 4	6 个月	新股	5.69	5.41	8,742	49,741.98	47,294.22	-

	集 成	月 28 日		流 通 受 限						
688472	阿 特 斯	2023 年 6 月 2 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688479	友 车 科 技	2023 年 5 月 4 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南 芯 科 技	2023 年 3 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	39.99	36.71	509	20,354.91	18,685.39	-
688507	索 辰 科 技	2023 年 4 月 10 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	245.56	122.11	129	21,363.72	15,752.19	-
688512	慧 智 微	2023 年 5 月 8 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航 天 环 宇	2023 年 5 月 26 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688535	华 海 诚 科	2023 年 3 月 28 日	6 个 月	新 股 流 通	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

				受限						
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-

688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
--------	------	-----------------	------	--------	-------	-------	-----	----------	-----------	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理，对公司建立风险管理体系和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，协助董事会进行风险管理，风险管理委员会负责起草公司风险管理战略，审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。经理层负责落实董事会拟定的风险管理政策，并对风险控制的有效执行承担责任。经理层下设风险控制委员会，协助经理层进行风险控制，风险控制委员会负责组织风险管理体系建设，确定风险管理原则、目标和方法，审议风险管理制度和流程，指导重大风险事件的处理。督察长负责监督检查公司风险管理工作的执行情况，评价公司内部风险控制制度的合法性、合规性和有效性，并向董事会报告。监察稽核部门为日常风险管理的执行部门，主要负责对公司经营管理及受托投资风险的预警和事中控制，对有关风险进行分析并向经理层汇报。公司各部门是风险控制措施的执行部门，负责识别和控制业务活动中潜在风险，做好风险的事先防范。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，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，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，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的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，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资。（2022 年 12 月 31 日，同）

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持证券均在证券交易所交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 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							

银行存款	215,092,097.64	-	-	-	-	-	215,092,097.64
结算备付金	11,611,505.95	-	-	-	-	-	11,611,505.95
存出保证金	778,347.86	-	-	-	-	-	778,347.86
交易性金融资产		-	-	-	-	2,487,567,131.41	2,487,567,131.41
应收申购款		-	-	-	-	93,013,841.41	93,013,841.41
应收清算款		-	-	-	-	2,497,599.94	2,497,599.94
资产总计	227,481,951.45	-	-	-	-	2,583,078,572.76	2,810,560,524.21
负债							
应付赎回款		-	-	-	-	68,633,762.43	68,633,762.43
应付管理人报酬		-	-	-	-	3,441,397.49	3,441,397.49
应付托管费		-	-	-	-	573,566.23	573,566.23
应付清算款		-	-	-	-	54,749,427.95	54,749,427.95
应付销售服务费		-	-	-	-	793,082.41	793,082.41
其他负债		-	-	-	-	6,691,100.38	6,691,100.38
负债总计		-	-	-	-	134,882,336.89	134,882,336.89
利率敏感度缺口	227,481,951.45	-	-	-	-	2,448,196,235.87	2,675,678,187.32
上年度末 2022 年 12 月 31 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							
银行存款	17,170,131.74	-	-	-	-	-	17,170,131.74
结算备付金	2,747,718.22	-	-	-	-	-	2,747,718.22
存出保证金	165,796.36	-	-	-	-	-	165,796.36
交易性金融资产		-	-	-	-	175,285,581.91	175,285,581.91
应收申购款	1,372.41	-	-	-	-	1,169,111.21	1,170,483.62
应收清算款		-	-	-	-	1,022,290.12	1,022,290.12
资产总计	20,085,018.73	-	-	-	-	177,476,983.24	197,562,001.97
负债							
应付赎回款		-	-	-	-	6,685,491.26	6,685,491.26
应付管理人报酬		-	-	-	-	253,852.68	253,852.68
应付托管费		-	-	-	-	42,308.77	42,308.77
应付销售服务费		-	-	-	-	54,462.69	54,462.69
其他负债		-	-	-	-	1,172,429.20	1,172,429.20
负债总计		-	-	-	-	8,208,544.60	8,208,544.60
利率敏感度缺口	20,085,018.73	-	-	-	-	169,268,438.64	189,353,457.37

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：同），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。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和交易的股票和债券，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。

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	2,487,567,131.41	92.97	175,285,581.91	92.57
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	2,487,567,131.41	92.97	175,285,581.91	92.57

注：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%–95%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0–50%；本基金投资于半导体产业主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈现线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 上升 1%	18,692,479.52	1,299,759.84
	沪深 300 下降 1%	-18,692,479.52	-1,299,759.84

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,485,654,230.69	174,892,164.48
第二层次	605,775.94	-
第三层次	1,307,124.78	393,417.43
合计	2,487,567,131.41	175,285,581.91

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基

金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以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

无。

§ 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	2,487,567,131.41	88.51
	其中：股票	2,487,567,131.41	88.51
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	226,703,603.59	8.07
8	其他各项资产	96,289,789.21	3.43
9	合计	2,810,560,524.21	100.00

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

金额单位：人民币元

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	2,088,413,610.71	78.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	391,397.47	0.01
E	建筑业	17,998,580.47	0.67
F	批发和零售业	482,437.62	0.02
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	379,609,200.85	14.19
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	157,912.84	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	235,674.49	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	278,316.96	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,487,567,131.41	92.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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	603019	中科曙光	2,684,600	136,646,140.00	5.11
2	301308	江波龙	1,315,250	133,839,840.00	5.00
3	688256	寒武纪	705,599	132,652,612.00	4.96
4	688041	海光信息	1,939,485	132,408,640.95	4.95
5	002156	通富微电	5,521,140	124,777,764.00	4.66
6	002463	沪电股份	5,500,000	115,170,000.00	4.30
7	002436	兴森科技	7,000,000	108,500,000.00	4.06
8	688368	晶丰明源	849,477	108,061,969.17	4.04
9	300223	北京君正	1,210,000	106,855,100.00	3.99
10	688110	东芯股份	2,895,379	104,523,181.90	3.91
11	002371	北方华创	314,200	99,805,630.00	3.73
12	600584	长电科技	3,182,534	99,199,584.78	3.71
13	002409	雅克科技	1,332,100	97,083,448.00	3.63
14	000938	紫光股份	3,000,000	95,550,000.00	3.57

15	000021	深科技	4, 569, 300	91, 340, 307. 00	3. 41
16	300260	新莱应材	2, 302, 850	91, 008, 632. 00	3. 40
17	688401	路维光电	2, 374, 383	89, 134, 337. 82	3. 33
18	002859	洁美科技	2, 789, 500	77, 269, 150. 00	2. 89
19	688123	聚辰股份	1, 047, 361	56, 264, 232. 92	2. 10
20	688596	正帆科技	1, 268, 000	54, 904, 400. 00	2. 05
21	688018	乐鑫科技	392, 647	50, 973, 433. 54	1. 91
22	688362	甬矽电子	1, 496, 474	49, 817, 619. 46	1. 86
23	300493	润欣科技	5, 357, 200	48, 857, 664. 00	1. 83
24	300820	英杰电气	569, 700	46, 931, 886. 00	1. 75
25	688661	和林微纳	650, 958	45, 762, 347. 40	1. 71
26	000063	中兴通讯	850, 000	38, 709, 000. 00	1. 45
27	688521	芯原股份	530, 482	38, 152, 265. 44	1. 43
28	688120	华海清科	129, 800	32, 716, 090. 00	1. 22
29	688072	拓荆科技	70, 000	29, 817, 900. 00	1. 11
30	300567	精测电子	200, 000	19, 030, 000. 00	0. 71
31	601133	柏诚股份	1, 205, 468	17, 972, 078. 33	0. 67
32	688498	源杰科技	5, 000	1, 425, 000. 00	0. 05
33	688472	阿特斯	62, 602	1, 141, 108. 20	0. 04
34	688443	智翔金泰	30, 329	933, 162. 53	0. 03
35	688361	中科飞测	8, 303	673, 991. 49	0. 03
36	688469	中芯集成	87, 419	493, 392. 81	0. 02
37	001286	陕西能源	37, 667	391, 397. 47	0. 01
38	688576	西山科技	2, 395	315, 642. 70	0. 01
39	688582	芯动联科	6, 476	299, 402. 44	0. 01
40	301310	鑫宏业	4, 089	280, 239. 27	0. 01
41	301293	三博脑科	3, 324	278, 316. 96	0. 01
42	301486	致尚科技	4, 820	277, 921. 20	0. 01
43	688552	航天南湖	9, 556	239, 960. 00	0. 01
44	688570	天玛智控	8, 837	234, 259. 64	0. 01
45	301307	美利信	6, 865	230, 766. 00	0. 01
46	688543	国科军工	4, 094	228, 607. 10	0. 01
47	001287	中电港	8, 273	224, 226. 66	0. 01
48	688146	中船特气	5, 130	214, 398. 09	0. 01
49	688458	美芯晟	2, 206	210, 955. 41	0. 01
50	688484	南芯科技	5, 081	207, 051. 79	0. 01
51	688352	颀中科技	15, 503	206, 235. 45	0. 01
52	688581	安杰思	1, 629	198, 809. 23	0. 01
53	301383	天键股份	4, 925	183, 366. 76	0. 01
54	688507	索辰科技	1, 285	166, 760. 47	0. 01
55	688435	英方软件	2, 244	163, 879. 32	0. 01
56	688629	华丰科技	7, 073	160, 957. 02	0. 01
57	301332	德尔玛	11, 211	159, 576. 87	0. 01

58	601061	中信金属	18,402	159,360.36	0.01
59	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.01
60	301305	朗坤环境	7,523	155,710.27	0.01
61	301320	豪江智能	6,416	155,624.88	0.01
62	301382	蜂助手	4,080	155,284.80	0.01
63	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.01
64	301387	光大同创	3,070	150,224.31	0.01
65	688512	慧智微	7,209	147,986.20	0.01
66	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.01
67	688433	华曙高科	4,141	139,756.50	0.01
68	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
69	301360	荣旗科技	1,340	138,170.08	0.01
70	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.00
71	688523	航天环宇	4,717	125,405.25	0.00
72	301141	中科磁业	2,617	119,750.28	0.00
73	603135	中重科技	5,938	119,644.26	0.00
74	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.00
75	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
76	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
77	688479	友车科技	3,318	103,760.10	0.00
78	301355	南王科技	5,624	99,516.05	0.00
79	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.00
80	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
81	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.00
82	688535	华海诚科	1,607	96,642.01	0.00
83	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.00
84	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.00
85	601065	江盐集团	6,882	91,329.75	0.00
86	301281	科源制药	3,366	88,363.72	0.00
87	688249	晶合集成	4,751	85,803.06	0.00
88	301280	珠城科技	2,252	80,531.52	0.00
89	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.00
90	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.00
91	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
92	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.00
93	603125	常青科技	1,596	44,779.00	0.00
94	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.00
95	301345	涛涛车业	696	33,131.26	0.00
96	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.00
97	603137	恒尚节能	1,382	26,502.14	0.00
98	001367	海森药业	549	24,687.92	0.00
99	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
100	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000938	紫光股份	221,545,140.13	117.00
2	002156	通富微电	210,506,114.75	111.17
3	688008	澜起科技	208,732,264.00	110.23
4	002371	北方华创	204,883,789.06	108.20
5	600584	长电科技	203,275,172.75	107.35
6	688368	晶丰明源	191,262,329.46	101.01
7	603019	中科曙光	174,497,323.87	92.15
8	002463	沪电股份	166,757,372.40	88.07
9	688099	晶晨股份	160,165,063.37	84.59
10	300260	新莱应材	139,644,804.91	73.75
11	688041	海光信息	139,384,716.35	73.61
12	301308	江波龙	137,116,640.09	72.41
13	688072	拓荆科技	136,283,939.80	71.97
14	300502	新易盛	127,294,085.25	67.23
15	688256	寒武纪	122,411,002.09	64.65
16	300223	北京君正	120,954,541.63	63.88
17	300474	景嘉微	120,671,263.62	63.73
18	300308	中际旭创	115,042,342.83	60.76
19	603501	韦尔股份	112,985,262.73	59.67
20	300820	英杰电气	110,626,988.19	58.42
21	688012	中微公司	108,160,577.58	57.12
22	688608	恒玄科技	107,993,405.73	57.03
23	688110	东芯股份	104,855,962.00	55.38
24	688048	长光华芯	103,050,659.12	54.42
25	688521	芯原股份	100,997,747.34	53.34
26	603893	瑞芯微	99,612,918.18	52.61
27	688123	聚辰股份	97,659,343.98	51.58
28	300567	精测电子	94,747,583.32	50.04
29	688037	芯源微	92,877,112.53	49.05
30	688981	中芯国际	92,085,557.35	48.63
31	688596	正帆科技	91,995,623.47	48.58
32	688401	路维光电	91,980,729.25	48.58
33	688120	华海清科	91,942,816.98	48.56
34	300394	天孚通信	88,531,101.61	46.75
35	000021	深科技	88,310,503.50	46.64
36	002409	雅克科技	88,274,920.16	46.62
37	002436	兴森科技	86,503,978.08	45.68
38	000063	中兴通讯	81,899,473.59	43.25

39	002859	洁美科技	81,841,020.66	43.22
40	300054	鼎龙股份	81,376,168.44	42.98
41	002222	福晶科技	79,566,268.84	42.02
42	688047	龙芯中科	78,547,918.70	41.48
43	300458	全志科技	66,059,059.70	34.89
44	688362	甬矽电子	65,767,079.19	34.73
45	688515	裕太微	56,605,637.54	29.89
46	688018	乐鑫科技	55,701,582.84	29.42
47	300493	润欣科技	51,435,009.28	27.16
48	688213	思特威	49,866,993.40	26.34
49	600183	生益科技	48,353,340.00	25.54
50	000066	中国长城	47,359,665.00	25.01
51	688147	微导纳米	43,971,910.33	23.22
52	300672	国科微	43,880,905.60	23.17
53	603986	兆易创新	43,163,943.46	22.80
54	688661	和林微纳	41,310,876.73	21.82
55	003031	中瓷电子	41,145,809.00	21.73
56	300990	同飞股份	40,508,281.14	21.39
57	688343	云天励飞	38,577,618.15	20.37
58	603186	华正新材	37,932,281.48	20.03
59	300476	胜宏科技	37,498,437.00	19.80
60	688502	茂莱光学	37,169,118.74	19.63
61	688498	源杰科技	36,639,811.14	19.35
62	600667	太极实业	35,730,491.28	18.87
63	688766	普冉股份	34,682,609.66	18.32
64	300620	光库科技	34,490,076.70	18.21
65	002916	深南电路	31,932,508.00	16.86
66	688141	杰华特	29,520,461.99	15.59
67	000988	华工科技	27,917,794.00	14.74
68	603650	彤程新材	27,752,577.32	14.66
69	688220	翱捷科技	27,642,132.24	14.60
70	002049	紫光国微	26,023,562.40	13.74
71	300604	长川科技	25,393,091.00	13.41
72	603061	金海通	21,183,160.65	11.19
73	600745	闻泰科技	21,061,183.41	11.12
74	301269	华大九天	20,981,850.75	11.08
75	601133	柏诚股份	20,769,975.08	10.97
76	688728	格科微	20,064,592.87	10.60
77	688107	安路科技	19,388,044.09	10.24
78	301183	东田微	19,191,012.70	10.14
79	688589	力合微	18,665,905.56	9.86
80	688409	富创精密	18,360,763.86	9.70
81	300831	派瑞股份	17,425,969.14	9.20

82	688082	盛美上海	17,300,200.99	9.14
83	002185	华天科技	16,667,042.00	8.80
84	300655	晶瑞电材	15,657,823.57	8.27
85	000100	TCL 科技	15,618,593.00	8.25
86	688206	概伦电子	15,210,276.36	8.03
87	688262	国芯科技	15,006,343.21	7.93
88	688486	龙迅股份	14,794,863.35	7.81
89	603005	晶方科技	14,729,976.00	7.78
90	300480	光力科技	14,652,220.50	7.74
91	603083	剑桥科技	12,250,054.00	6.47
92	600641	万业企业	12,168,224.00	6.43
93	300323	华灿光电	12,078,731.66	6.38
94	603290	斯达半导	12,037,436.30	6.36
95	002402	和而泰	11,188,028.00	5.91
96	002729	好利科技	11,026,223.08	5.82
97	605111	新洁能	10,701,643.20	5.65
98	688391	炬泉科技	10,104,520.89	5.34
99	605376	博迁新材	9,655,691.00	5.10
100	688172	燕东微	9,350,595.14	4.94
101	688167	炬光科技	8,661,065.27	4.57
102	688372	伟测科技	8,572,833.01	4.53
103	688252	天德钰	8,506,810.37	4.49
104	688035	德邦科技	8,462,087.29	4.47
105	688049	炬芯科技	8,133,002.55	4.30
106	688103	国力股份	8,110,743.32	4.28
107	688332	中科蓝讯	7,974,705.68	4.21
108	603690	至纯科技	7,855,777.00	4.15
109	603936	博敏电子	7,684,650.42	4.06
110	603306	华懋科技	7,597,303.00	4.01
111	688234	天岳先进	7,412,537.74	3.91
112	688385	复旦微电	7,341,435.92	3.88
113	603931	格林达	7,173,901.44	3.79
114	688380	中微半导	7,093,880.43	3.75
115	300408	三环集团	6,763,914.00	3.57
116	688259	创耀科技	5,226,678.73	2.76
117	688489	三未信安	4,993,949.95	2.64
118	688381	帝奥微	4,842,415.89	2.56
119	688017	绿的谐波	4,632,996.80	2.45
120	300666	江丰电子	4,210,353.26	2.22
121	002654	万润科技	4,016,240.00	2.12
122	301099	雅创电子	4,002,368.00	2.11
123	688630	芯碁微装	3,826,273.36	2.02

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	300308	中际旭创	219,986,762.61	116.18
2	688008	澜起科技	201,203,585.00	106.26
3	688099	晶晨股份	167,580,853.45	88.50
4	300502	新易盛	159,608,003.12	84.29
5	688048	长光华芯	150,147,321.57	79.29
6	300394	天孚通信	129,702,674.80	68.50
7	600584	长电科技	121,044,679.56	63.93
8	688012	中微公司	114,337,616.49	60.38
9	002371	北方华创	110,878,163.58	58.56
10	603501	韦尔股份	110,414,253.55	58.31
11	688608	恒玄科技	109,935,650.74	58.06
12	000938	紫光股份	108,218,928.15	57.15
13	688072	拓荆科技	106,773,649.60	56.39
14	300474	景嘉微	105,524,397.25	55.73
15	603893	瑞芯微	96,382,853.68	50.90
16	688047	龙芯中科	89,890,528.19	47.47
17	688037	芯源微	89,540,896.69	47.29
18	002156	通富微电	85,445,041.44	45.12
19	688981	中芯国际	82,601,726.06	43.62
20	300054	鼎龙股份	79,872,124.28	42.18
21	002222	福晶科技	78,809,837.41	41.62
22	300567	精测电子	71,788,318.00	37.91
23	300458	全志科技	70,932,670.18	37.46
24	300820	英杰电气	66,931,062.50	35.35
25	603019	中科曙光	65,323,635.34	34.50
26	688521	芯原股份	63,294,268.49	33.43
27	688368	晶丰明源	60,973,143.51	32.20
28	300260	新莱应材	59,283,076.20	31.31
29	688120	华海清科	58,915,602.14	31.11
30	688515	裕太微	56,830,897.92	30.01
31	002463	沪电股份	55,334,280.20	29.22
32	603986	兆易创新	55,172,768.67	29.14
33	688213	思特威	49,364,465.63	26.07
34	000066	中国长城	48,668,965.78	25.70
35	600183	生益科技	46,307,338.00	24.46
36	300672	国科微	46,306,263.00	24.45
37	000063	中兴通讯	45,721,419.00	24.15
38	688596	正帆科技	44,594,884.44	23.55
39	688147	微导纳米	41,548,361.42	21.94
40	603186	华正新材	41,183,796.00	21.75

41	300476	胜宏科技	38,953,457.70	20.57
42	003031	中瓷电子	38,877,673.00	20.53
43	300990	同飞股份	36,797,268.00	19.43
44	688123	聚辰股份	35,914,560.84	18.97
45	688502	茂莱光学	34,723,499.38	18.34
46	688498	源杰科技	34,602,865.58	18.27
47	688343	云天励飞	34,452,577.03	18.19
48	600667	太极实业	34,103,542.00	18.01
49	688766	普冉股份	33,360,785.41	17.62
50	002916	深南电路	29,643,291.00	15.66
51	603650	彤程新材	28,881,340.00	15.25
52	000988	华工科技	28,055,872.00	14.82
53	300620	光库科技	27,667,320.00	14.61
54	688220	翱捷科技	26,067,361.39	13.77
55	002049	紫光国微	25,926,336.00	13.69
56	688141	杰华特	23,857,732.04	12.60
57	301269	华大九天	23,200,568.66	12.25
58	300604	长川科技	23,195,162.74	12.25
59	688107	安路科技	22,473,176.64	11.87
60	603061	金海通	20,810,036.00	10.99
61	600745	闻泰科技	20,514,987.00	10.83
62	002859	洁美科技	20,080,273.00	10.60
63	688728	格科微	19,682,703.79	10.39
64	688589	力合微	18,876,590.80	9.97
65	688082	盛美上海	18,334,123.46	9.68
66	300655	晶瑞电材	17,762,372.21	9.38
67	300831	派瑞股份	16,985,145.50	8.97
68	688409	富创精密	16,911,108.48	8.93
69	002185	华天科技	16,826,073.00	8.89
70	688486	龙迅股份	16,567,526.43	8.75
71	300661	圣邦股份	16,547,542.00	8.74
72	301183	东田微	16,173,207.74	8.54
73	688798	艾为电子	15,720,547.41	8.30
74	000100	TCL 科技	15,372,786.00	8.12
75	688262	国芯科技	15,343,743.25	8.10
76	688206	概伦电子	15,158,280.90	8.01
77	603083	剑桥科技	14,587,044.00	7.70
78	300480	光力科技	14,326,477.00	7.57
79	603306	华懋科技	13,077,486.00	6.91
80	603290	斯达半导	11,993,662.90	6.33
81	300323	华灿光电	11,733,190.00	6.20
82	600641	万业企业	11,487,472.00	6.07
83	688362	甬矽电子	11,325,161.97	5.98

84	002402	和而泰	11,223,827.00	5.93
85	603005	晶方科技	11,187,641.00	5.91
86	605111	新洁能	10,873,314.00	5.74
87	002729	好利科技	10,466,794.00	5.53
88	603738	泰晶科技	10,198,430.60	5.39
89	688035	德邦科技	9,841,983.63	5.20
90	688256	寒武纪	9,754,976.37	5.15
91	605376	博迁新材	9,527,107.00	5.03
92	688391	钜泉科技	9,400,377.14	4.96
93	688536	思瑞浦	9,270,378.66	4.90
94	300782	卓胜微	9,253,627.60	4.89
95	688252	天德钰	9,247,920.37	4.88
96	688172	燕东微	9,117,950.81	4.82
97	688381	帝奥微	8,807,824.76	4.65
98	688049	炬芯科技	8,400,643.59	4.44
99	688167	炬光科技	8,176,416.52	4.32
100	688103	国力股份	7,964,118.04	4.21
101	688332	中科蓝讯	7,948,805.79	4.20
102	688372	伟测科技	7,943,300.38	4.19
103	603690	至纯科技	7,931,160.00	4.19
104	603936	博敏电子	7,573,114.00	4.00
105	688385	复旦微电	7,127,349.10	3.76
106	688234	天岳先进	7,070,240.42	3.73
107	603931	格林达	6,988,708.00	3.69
108	688380	中微半导	6,876,057.83	3.63
109	300408	三环集团	6,532,475.36	3.45
110	300223	北京君正	5,815,767.00	3.07
111	688017	绿的谐波	5,474,611.05	2.89
112	688259	创耀科技	4,835,688.91	2.55
113	688489	三未信安	4,831,377.10	2.55
114	002654	万润科技	4,485,528.00	2.37
115	688630	芯碁微装	4,276,118.01	2.26
116	301099	雅创电子	4,236,145.00	2.24
117	300666	江丰电子	4,005,199.00	2.12
118	301308	江波龙	3,944,207.00	2.08

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	6,973,984,458.47
卖出股票收入（成交）总额	4,838,487,189.51

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

上海晶丰明源半导体股份有限公司

2023 年 6 月 6 日，公司因信息披露不及时、不准确、不完整，未揭示相关风险等违规行为，被上海证券交易所被予以监管警示。

2022 年 12 月 15 日，上海晶丰明源半导体股份有限公司因存在违反《企业会计准则第 30 号--财务报表列报》(财会〔2022〕4 号)第十七条、第十八条，《公开发行证券的公司信息披露编报规则第 15 号--财务报告的一般规定》(证监会公告〔2014〕54 号)第七条，以及《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第 182 号)第三条第一款、第十四条第十项、第十五条第七项的规定，被中国证券监督管理委员会上海监管局采取出具警示函的监督管理措施。

除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选库之外的股票。

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	778,347.86
2	应收清算款	2,497,599.94
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	93,013,792.78
6	其他应收款	48.63
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	96,289,789.21

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
德邦半导体产业混合发起式 A	24,498	14,675.75	94,659,179.15	26.33	264,867,440.70	73.67
德邦半导体产业混	167,807	12,629.27	304,750,528.45	14.38	1,814,529,878.78	85.62

合发起式 C						
合计	192,305	12,889.98	399,409,707.60	16.11	2,079,397,319.48	83.89

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	德邦半导体产业混合发起式 A	688,159.74	0.1914
	德邦半导体产业混合发起式 C	572,433.60	0.0270
	合计	1,260,593.34	0.0509

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	德邦半导体产业混合发起式 A	10~50
	德邦半导体产业混合发起式 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	德邦半导体产业混合发起式 A	10~50
	德邦半导体产业混合发起式 C	0~10
	合计	10~50

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	10,000,000.00	0.40	10,000,000.00	0.40	3 年
基金管理人高级管理人员	278,719.50	0.01	-	-	-
基金经理等人员	278,876.25	0.01	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,557,595.75	0.43	10,000,000.00	0.40	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	德邦半导体产业混合发起式 A	德邦半导体产业混合发起式 C
基金合同生效日 (2021 年 12 月 28 日) 基金份额总额	13,818,368.07	460,509.53
本报告期期初基金 份额总额	48,364,144.82	202,283,441.64
本报告期基金总申 购份额	635,780,022.42	6,166,719,226.94
减：本报告期基金 总赎回份额	324,617,547.39	4,249,722,261.35
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	359,526,619.85	2,119,280,407.23

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，莫秋琴女士担任基金管理人副总经理，吴晨先生不再担任基金管理人副总经
理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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、本基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本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

报告期内本基金未改聘其审计的会计师事务所。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
自基金合同生效日起至本报告期末，向本基金提供审计服务。

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

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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 (%)	
民生证券	2	2,444,074,8 40.77	20.71	1,762,913.4 2	20.57	-
东吴证券	2	2,073,577,5 87.40	17.57	1,516,407.2 0	17.69	-
东莞证券	2	1,842,179,7 11.69	15.61	1,347,183.8 4	15.72	-
天风证券	2	1,414,734,2 01.28	11.99	1,032,079.3 1	12.04	-
东方财富 证券	2	1,272,622,7 85.16	10.78	917,947.79	10.71	-
长江证券	2	797,162,575 .35	6.76	574,990.65	6.71	-
浙商证券	2	700,304,496 .17	5.93	505,131.48	5.89	-
西部证券	2	625,618,971 .79	5.30	454,850.65	5.31	-
德邦证券	2	454,591,576 .13	3.85	332,440.08	3.88	-
中泰证券	2	175,094,342 .64	1.48	126,295.18	1.47	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择基金专用交易席位的基本选择标准：

- (一) 注册资本不低于 1 亿元人民币；
- (二) 财务状况良好，各项风险监控指标符合证监会的相关规定；
- (三) 经营行为规范，未就交易单元发生违约或侵权行为；
- (四) 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足投资组合资产运作高度保

密的要求；

(五) 具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理各投资组合进行证券交易的需要；

(六) 研究实力较强，能根据需求提供质量较高的研究报告，以及相应的信息咨询服务；

(七) 收取的佣金费率合理。

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

(一) 研究部按照上述选择标准对证券公司进行初步筛选，经投资总监批准后提请总经理审批；

(二) 交易部办理相关交易单元，信息技术部、基金运营部和监察稽核部等相关部门配合完成交易单元租用的技术准备、参数调整及合同签订并及时通知各投资组合的托管机构等事宜。

2、本报告期内，本基金新增民生证券、西部证券、信达证券、中泰证券、长江证券、首创证券、东方财富证券、浙商证券、东吴证券交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-

券						
首创证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

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	德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加工商银行个人电子银行费率优惠活动及 2023 倾心回馈基金定投优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 3 日
2	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 9 日
3	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 18 日
4	德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 19 日
5	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 3 日
6	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 6 日
7	德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 18 日
8	德邦基金管理有限公司关于德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金增加广发证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 28 日
9	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 8 日
10	德邦基金管理有限公司关于德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金增加腾安基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 16 日
11	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 24 日
12	德邦基金管理有限公司关于德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 29 日

	公告标题	披露日期
13	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为销售机构的公告	2023 年 3 月 30 日
14	德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	2023 年 3 月 31 日
15	德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	2023 年 4 月 1 日
16	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信百信银行为销售机构的公告	2023 年 4 月 4 日
17	德邦基金管理有限公司关于德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金增加兴业证券为销售机构的公告	2023 年 4 月 7 日
18	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构的公告	2023 年 4 月 10 日
19	德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	2023 年 4 月 13 日
20	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购（含转换转入及定期定额投资）、赎回（含转换转出）业务的公告	2023 年 4 月 24 日
21	德邦基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在平安证券最低申购（含定期定额投资）金额、追加申购最低金额的公告	2023 年 4 月 26 日
22	德邦基金管理有限公司关于德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金增加华泰证券为销售机构的公告	2023 年 4 月 26 日
23	德邦基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	2023 年 5 月 17 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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内按照规定披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件，亦可通过公司网站查询，公司网址为 www.dbfund.com.cn。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-821-7788

德邦基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日