

德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式
证券投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：德邦基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 03 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。本年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2024 年 3 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。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	50

8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	51
8.3 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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	80
8.6 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.....	80
8.7 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.....	81
8.8 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.....	81
8.9 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.....	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	81
8.12 市场中性策略执行情况.....	81
8.13 投资组合报告附注.....	81
§ 9 基金份额持有人信息	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
9.3 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.....	83
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	83
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	83
§ 10 开放式基金份额变动	84
§ 11 重大事件揭示	84
11.1 基金份额持有人大会决议.....	84
11.2 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.....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
11.4 基金投资策略的改变.....	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
11.8 其他重大事件.....	87
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	91
12.1 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	91
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	92
§ 13 备查文件目录	92
13.1 备查文件目录.....	92
13.2 存放地点.....	92
13.3 查阅方式.....	92

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	德邦量化对冲混合	
基金主代码	008838	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 29 日	
基金管理人	德邦基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,124,949.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
下属分级基金的交易代码	008838	008839
报告期末下属分级基金的份额总额	17,699,185.37 份	7,425,764.26 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资模型,灵活采用多种策略对冲股票组合的系统性风险,在严格控制主动风险的前提下,谋求投资组合资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济环境、政策形式、证券市场走势的综合分析、国际市场变化情况等因素的深入研究,主动判断市场时机,综合评价各类资产的风险收益水平,进行积极的资产配置,合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例,并进行动态调整。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期银行定期存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金为特殊的灵活配置混合型发起式基金,通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险,因此,预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金和一般的混合型基金。

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		德邦基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐晓红	陆志俊
	联系电话	021-26010852	95559
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008217788	95559
传真		021-26010808	021-62701216
注册地址		上海市虹口区东大名路 501 号 503B 单元	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市杨浦区荆州路 198 号万硕	中国(上海)长宁区仙霞路 18

	大厦 A 栋 25 楼	号
邮政编码	200082	200336
法定代表人	左畅	任德奇

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dbfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	德邦基金管理有限公司	上海市虹口区东大名路 501 号 503B 单元

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年		2021 年	
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
本期已实现收益	-592,079.14	378,452.90	-133,738.33	-77,497.19	-3,131,911.18	-1,855,510.72
本期利润	-20,533.40	-80,236.48	-89,784.37	-41,921.34	-1,994,505.28	-2,420,671.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0010	-0.0028	-0.0047	-0.0173	-0.0599	-0.0786
本期加权平均净值利润率	-0.11%	-0.31%	-0.52%	-1.91%	-6.08%	-7.96%
本期基金份额净值增长率	-0.10%	-0.36%	-0.33%	-0.58%	-8.17%	-8.43%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-2,563,856.05	-1,137,723.61	-2,029,313.83	-554,926.43	-2,277,744.24	-268,954.94
期末可供分配基金份额利润	-0.1449	-0.1532	-0.1162	-0.1223	-0.1099	-0.1139
期末基金资产	16,178,181	6,723,334.	15,984,198	4,121,872.	19,019,861	2,158,894.

产净值	.01	93	.90	93	.93	00
期末基金份额净值	0.9141	0.9054	0.9150	0.9087	0.9180	0.9140
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-8.59%	-9.46%	-8.50%	-9.13%	-8.20%	-8.60%

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

德邦量化对冲混合 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
过去三个月	0.64%	0.21%	0.38%	0.01%	0.26%	0.20%
过去六个月	0.58%	0.19%	0.76%	0.00%	-0.18%	0.19%
过去一年	-0.10%	0.20%	1.51%	0.00%	-1.61%	0.20%
过去三年	-8.56%	0.34%	4.60%	0.00%	-13.16%	0.34%
自基金合同生效起至今	-8.59%	0.32%	5.67%	0.00%	-14.26%	0.32%

德邦量化对冲混合 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
过去三个月	0.57%	0.21%	0.38%	0.01%	0.19%	0.20%
过去六个月	0.45%	0.19%	0.76%	0.00%	-0.31%	0.19%
过去一年	-0.36%	0.20%	1.51%	0.00%	-1.87%	0.20%

过去三年	-9.29%	0.34%	4.60%	0.00%	-13.89%	0.34%
自基金合同生效起至今	-9.46%	0.32%	5.67%	0.00%	-15.13%	0.32%

注：本基金业绩比较基准：中国人民银行公布的同期一年期银行定期存款基准利率（税后）

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

德邦量化对冲混合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



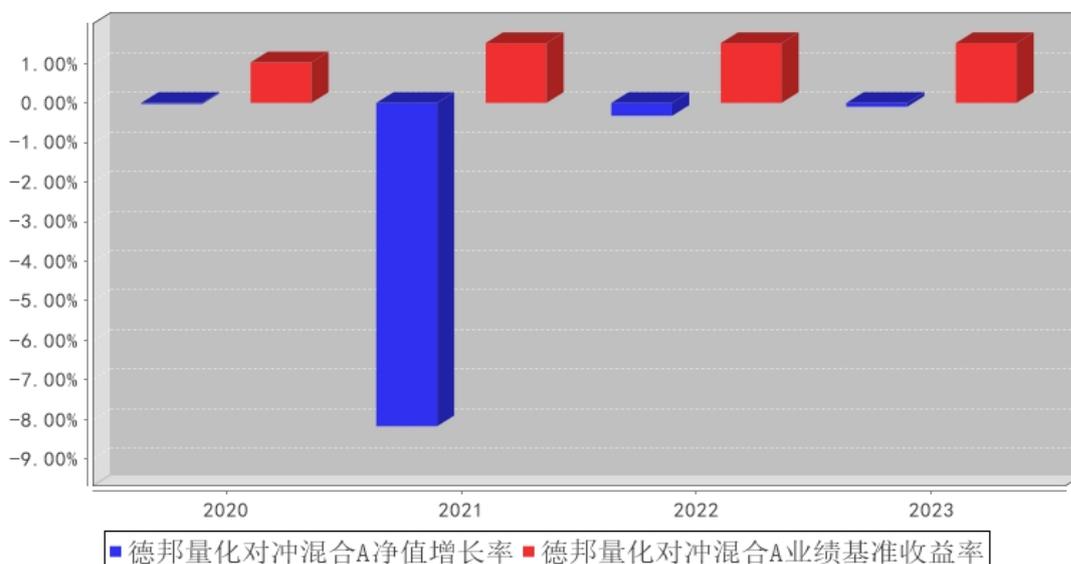
德邦量化对冲混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



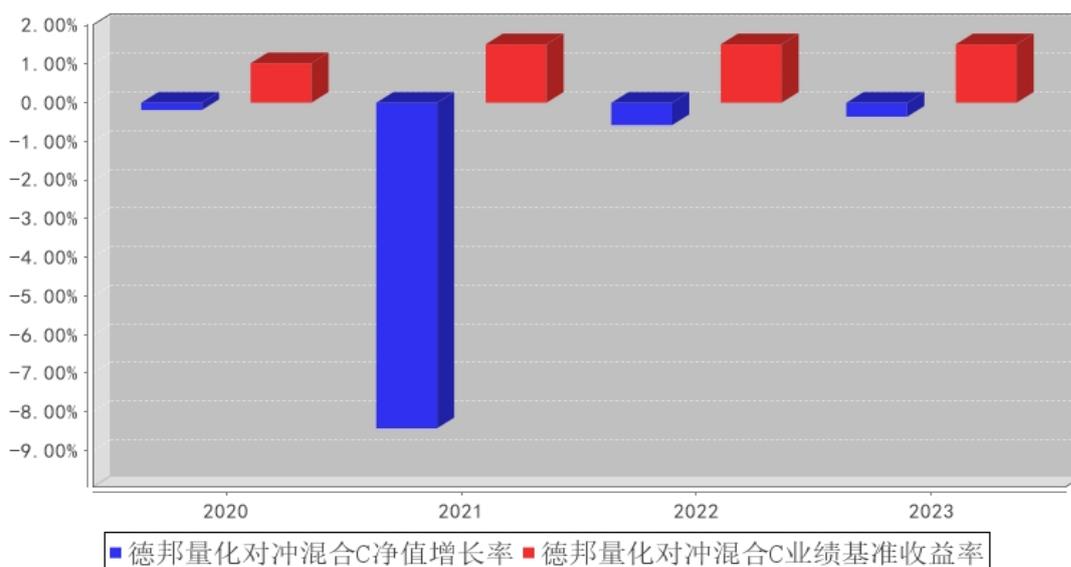
注：本基金的基金合同生效日为 2020 年 04 月 29 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满 1 年。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2020 年 04 月 29 日至 2023 年 12 月 31 日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦量化对冲混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



德邦量化对冲混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 29 日，2020 年度数据根据合同生效当年实际存续期（2020 年 4 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日）计算，未满一年，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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、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12月31日，本基金管理人共管理三十一只开放式基金：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、德邦稳盈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		
李荣兴	本基金的基金经理	2022年6月17日	-	12年	硕士，北京大学计算机系硕士，2011年起历任国信证券金融工程分析师，光大富尊投资有限公司量化投资经理，太平资产量化投资部投资经理。2022年3月加入德邦基金，现任公司基金经理。
吴志鹏	无	2021年6月29日	2023年11月20日	7年	硕士，于2016年4月加入德邦基金管理有限公司，历任投资三部（量化）研究员，

		日	日		专户投资部投资经理, 量化投资部研究员。 现任公司基金经理。
--	--	---	---	--	-----------------------------------

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易控制机制，确保管理的不同受托资产得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，本基金管理人建立了科学的研究方法以及规范的研究管理平台，实行证券备选库和交易对手备选库制度，各受托资产之间实行防火墙制度，通过系统的投资决策方法和明确的投资授权制度，保证受托投资决策的客观性和独立性。

在交易执行方面，本基金管理人实行集中交易制度，并建立了公平的交易分配流程，保证投资指令得以公平对待。对以本基金管理人的名义参与债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易的，相关基金经理或投资经理应独立确定各受托资产拟申购的价格和数量，基金管理人在获配额度后，按照价格优先、比例分配的原则进行分配。对以各受托资产名义参与银行间交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的，交易部应充分询价，利用市场公认的第三方信息对交易价格的公允性进行审查，确保各受托资产获得公平的交易机会。

监察稽核部门对投资交易行为进行定期或不定期检查，重点关注公平交易的执行情况和异常交易行为的监控情况。严禁同一受托资产的同日反向交易及其他可能导致不公平或利益输送的交易行为，但完全按照有关指数构成比例进行证券投资的受托资产除外。严格控制不同受托资产间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易或利益输送的同日反向交易行为。监察稽核部门对不

同受托资产，尤其是同一位基金经理或投资经理管理的不同受托资产同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同受托资产临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。发现异常交易情况的，可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。监察稽核部门对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同受托资产买卖该异常交易证券的情况进行分析。发现异常交易情况的，可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。监察稽核部门编制定期公平交易报告，重点分析本基金管理人管理的不同受托资产整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及同一期间、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同受托资产同向交易的交易价差。公平交易报告由基金经理或投资经理确认后报督察长、总经理审阅。

4.3.2 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，并对连续四个季度期间内、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。

4.3.3 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

回顾 2023 年下半年，全球经济复苏进程依然曲折，地缘政治紧张局势不断升级，而国内也面临着行业政策调整、自然灾害等多重挑战。在这样的背景下，A 股市场经历了显著的波动。中国经济总体保持了恢复态势，但增速略有放缓。杭州亚运会的举办对旅游、餐饮、零售等相关行业产生了显著的拉动效应。上证指数在多重因素的影响下出现了明显的波动。尽管面临诸多不利因素，市场流动性依然保持充裕，为市场的稳定提供了重要支撑。在经历了一段时间的调整后，市场在找到平衡点后逐渐开启了反弹行情。在这轮反弹中，中小市值板块表现出较强的韧性，尤其

是具备成长潜力和创新能力的企业。

股指期货方面，考虑指数分红的因素后，目前期指的近月合约基本没有基差，远月度合约小幅贴水，本基金维持中性仓位以应对。

在投资管理上，本基金严格监控各项风险暴露，控制个股风险，模型运行比较平稳，在中证 800 和中证 1000 的成分股内结合海量因子驱动的人工智能模型、以基本面为驱动的多因子选股模型，把握优质个股的投资机会，积极获取超额收益率。报告期内，本基金主要使用中证 1000 及沪深 300 股指期货合约进行对冲，以获得绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末德邦量化对冲混合 A 基金份额净值为 0.9141 元，基金份额净值增长率为 -0.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.51%；德邦量化对冲混合 C 基金份额净值为 0.9054 元，基金份额净值增长率为 -0.36%，同期业绩比较基准收益率为 1.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年上半年，全球经济预计将继续呈现复苏态势，但增速可能因各种不确定性因素而有所放缓。中国经济有望在政策支持和内需拉动的共同作用下保持稳定增长。政策方面，各国政府可能会继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，以应对经济增长放缓和通胀压力。同时，加强国际合作，推动全球经济治理体系的完善也将成为重要议题。在宏观经济复苏和政策支持的背景下，2024 年上半年证券市场有望呈现震荡上行的态势。投资者信心可能逐渐恢复，市场流动性保持充裕。然而，市场波动可能加大，具体来看，发达国家市场可能面临货币政策收紧和经济增长放缓的双重压力，新兴市场则可能受益于全球经济复苏和资本流入。中国证券市场有望在政策引导和内需拉动的共同作用下保持稳定表现，但市场分化可能加剧，需要关注结构性机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续坚持以维护基金份额持有人利益为宗旨，以规范运作、防范风险、维护投资人利益为原则，严格依据法律法规和公司内控制度进行监察稽核工作，切实防范公司运营和投资组合运作的风险，保障公司合规、稳健发展。

合规管理方面，2023 年，公司董事会、监事会、经营管理层、各层级部门及人员、子公司继续贯彻落实各自合规管理职责，深入理解法律法规和自律规则，并在经营决策、运营管理和执业行为过程中识别、防范及化解合规风险。2023 年，公司总体上实现了通过建立和执行合规管理制度和机制，有效识别和防范合规风险，保护投资者合法权益，维护股东、公司及全体员工合法利益的合规管理要求。风险管理方面，2023 年，公司继续加强全面风险管理工作，风险管理覆盖公司各项业务、各个部门或机构和各级人员，并贯穿到决策、执行、监督、反馈等各个环节，有效

识别、化解和防范各类风险。稽核审计方面，2023 年，稽核审计工作继续加大对投资、研究、交易、销售、登记注册、基金估值等关键业务环节以及监管关注重点问题的检查力度，并及时跟踪各项工作整改进度，督促相关部门完善制度、流程，保障公司各项业务稳步开展。

综合以上情况，2023 年，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续加强内部合规控制、风险管理以及稽核审计工作，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

4.7 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其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验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 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。

4.9 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

本基金本报告期内连续二十个工作日以上出现基金资产净值低于五千万元的情形，截至本报告期末，本基金基金资产净值仍低于五千万元。

§ 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

2023 年度，基金托管人在德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2023 年度，德邦基金管理有限公司在德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2023 年度，由德邦基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70066381_B21 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于德邦量化对冲策略灵活配置混合型

	发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，</p>

	<p>根据获取的审计证据，就可能对德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	藺育化	徐雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2024 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,053,176.83	5,199,702.70
结算备付金		1,881,703.69	1,738,174.68
存出保证金		1,915,808.67	1,791,854.13
交易性金融资产	7.4.7.2	17,193,500.39	13,104,607.45
其中：股票投资		17,158,452.41	13,086,929.21
基金投资		-	-
债券投资		35,047.98	17,678.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		130.00	7,850.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		23,044,319.58	21,842,189.38
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,621,712.41
应付赎回款		23,169.37	31,814.53
应付管理人报酬		19,821.28	17,075.96
应付托管费		3,964.24	3,415.21
应付销售服务费		1,506.72	875.24
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	7.4.7.9	94,342.03	61,224.20
负债合计		142,803.64	1,736,117.55
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	25,124,949.63	22,005,105.25
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-2,223,433.69	-1,899,033.42
净资产合计		22,901,515.94	20,106,071.83
负债和净资产总计		23,044,319.58	21,842,189.38

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，德邦量化对冲混合 A 基金份额净值 0.9141 元，基金份额总额 17,699,185.37 份；德邦量化对冲混合 C 基金份额净值 0.9054 元，基金份额总额 7,425,764.26 份。德邦量化对冲混合份额总额合计 25,124,949.63 份。

7.2 利润表

会计主体：德邦量化对冲策略灵活配置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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		585,767.42	166,010.07
1. 利息收入		73,905.98	59,238.52
其中：存款利息收入	7.4.7.13	72,744.18	59,238.52
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		1,161.80	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		29,322.43	21,719.57
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-5,760,051.89	-2,075,616.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	9,410.67	12.81
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	5,247,639.70	1,894,099.27
股利收益	7.4.7.19	532,323.95	203,223.79
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）	7.4.7.20	112,856.36	79,529.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	369,682.65	5,522.17
减：二、营业总支出		686,537.30	297,715.78
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	455,420.82	195,409.23
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	91,084.23	39,081.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	68,456.86	5,428.51
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		19,075.39	9,596.13
8. 其他费用	7.4.7.23	52,500.00	48,200.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-100,769.88	-131,705.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-100,769.88	-131,705.71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-100,769.88	-131,705.71

7.3 净资产变动表

会计主体：德邦量化对冲策略灵活配置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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	22,005,105.25	-	-1,899,033.42	20,106,071.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	22,005,105.25	-	-1,899,033.42	20,106,071.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,119,844.38	-	-324,400.27	2,795,444.11
（一）、综合收益总额	-	-	-100,769.88	-100,769.88
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	3,119,844.38	-	-223,630.39	2,896,213.99
其中：1. 基金申购款	300,550,333.18	-	-30,484,581.25	270,065,751.93
2. 基金赎回款	-297,430,488.80	-	30,260,950.86	-267,169,537.94
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	25,124,949.63	-	-2,223,433.69	22,901,515.94
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31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	23,081,727.56	-	-1,902,971.63	21,178,755.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	23,081,727.56	-	-1,902,971.63	21,178,755.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,076,622.31	-	3,938.21	-1,072,684.10
（一）、综合收益总额	-	-	-131,705.71	-131,705.71
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,076,622.31	-	135,643.92	-940,978.39
其中：1. 基金申购款	5,657,611.43	-	-491,494.27	5,166,117.16
2. 基金赎回款	-6,734,233.74	-	627,138.19	-6,107,095.55
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	22,005,105.25	-	-1,899,033.42	20,106,071.83
-----------	---------------	---	---------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张騷</u>	<u>洪双龙</u>	<u>洪双龙</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

德邦量化对冲策略灵活配置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[2019]2890 号文《关于准予德邦量化对冲策略灵活配置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向社会公开募集，基金合同于 2020 年 4 月 29 日生效。首次设立时募集规模为 191,956,539.03 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为德邦基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股票期权、股指期货、国债期货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。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期一年期银行定期存款基准利率（税后）。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债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负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值

产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的

金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的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当期损益的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；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 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，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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相应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；基金份额持有人可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费。同一投资人在同一销售机构持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式；

(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任一类基金份额净值减去每单位该类别基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同，基金管理人可对各基金份额类别分别制定收益分配方案。本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 在不违背法律法规及基金合同的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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%；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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。

7.4.6.2 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开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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	2,053,176.83	5,199,702.70
等于：本金	2,053,055.09	5,199,233.22
加：应计利息	121.74	469.48
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	2,053,176.83	5,199,702.70

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	17,213,768.25	-	17,158,452.41	-55,315.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	17.10	35,047.98	4,830.88
	银行间市场	-	-	-
	合计	30,200.00	17.10	35,047.98
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,243,968.25	17.10	17,193,500.39	-50,484.96
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	13,493,838.04	-	13,086,929.21	-406,908.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	12.82	17,678.24	3,465.42
	银行间市场	-	-	-
	合计	14,200.00	12.82	17,678.24
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	13,508,038.04	12.82	13,104,607.45	-403,443.41

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍	-	-	-	-

生工具				
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-15,812,891.25	-	-	-
其中：股指期货投资	-15,812,891.25	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-15,812,891.25	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-12,642,373.34	-	-	-
其中：股指期货投资	-12,642,373.34	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-12,642,373.34	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2401	IF2401	-5.00	-5,159,700.00	-89,208.75
IM2401	IM2401	-9.00	-10,598,400.00	144,000.00
合计				54,791.25
减：可抵销期货暂收款				54,791.25
净额				-

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末及上年度末不存在按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均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。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均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。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均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。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均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。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.14	3.19
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	59,841.89	31,221.01
其中：交易所市场	59,841.89	31,221.01
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	30,000.00	30,000.00
应付账户维护费	4,500.00	-
合计	94,342.03	61,224.20

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

德邦量化对冲混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,469,286.43	17,469,286.43
本期申购	13,854,150.74	13,854,150.74
本期赎回（以“-”号填列）	-13,624,251.80	-13,624,251.80
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	17,699,185.37	17,699,185.37

德邦量化对冲混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,535,818.82	4,535,818.82
本期申购	286,696,182.44	286,696,182.44
本期赎回（以“-”号填列）	-283,806,237.00	-283,806,237.00
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	7,425,764.26	7,425,764.26

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

德邦量化对冲混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,029,313.83	544,226.30	-1,485,087.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-2,029,313.83	544,226.30	-1,485,087.53
本期利润	-592,079.14	571,545.74	-20,533.40
本期基金份额交易产生的变动数	57,536.92	-72,920.35	-15,383.43
其中：基金申购款	-1,649,255.18	361,175.91	-1,288,079.27
基金赎回款	1,706,792.10	-434,096.26	1,272,695.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,563,856.05	1,042,851.69	-1,521,004.36

德邦量化对冲混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-554,926.43	140,980.54	-413,945.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-554,926.43	140,980.54	-413,945.89
本期利润	378,452.90	-458,689.38	-80,236.48
本期基金份额交易产生的变动数	-961,250.08	753,003.12	-208,246.96
其中：基金申购款	-37,702,994.65	8,506,492.67	-29,196,501.98
基金赎回款	36,741,744.57	-7,753,489.55	28,988,255.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,137,723.61	435,294.28	-702,429.33

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	15,440.34	8,303.18
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	56,657.46	50,760.44
其他	646.38	174.90

合计	72,744.18	59,238.52
----	-----------	-----------

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,760,051.89	-2,075,616.30
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	-5,760,051.89	-2,075,616.30

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	500,591,694.51	167,618,677.35
减：卖出股票成本总额	505,495,449.26	169,351,683.70
减：交易费用	856,297.14	342,609.95
买卖股票差价收入	-5,760,051.89	-2,075,616.30

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	33.79	12.81

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,376.88	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	9,410.67	12.81

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	44,708.17	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,300.00	-
减：应计利息总额	29.51	-
减：交易费用	1.78	-
买卖债券差价收入	9,376.88	-

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	5,247,639.70	1,894,099.27

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	532,323.95	203,223.79
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	532,323.95	203,223.79

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	352,958.45	-197,783.53
股票投资	351,592.99	-201,248.95

债券投资	1,365.46	3,465.42
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-240,102.09	277,313.34
权证投资	-	-
期货投资	-240,102.09	277,313.34
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	112,856.36	79,529.81

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	369,383.30	5,488.47
基金转换费收入	299.35	33.70
合计	369,682.65	5,522.17

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
账户维护费	22,500.00	18,000.00
其他	-	200.00
合计	52,500.00	48,200.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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
西子联合控股有限公司	基金管理人的股东
浙江省土产畜产进出口集团有限公司	基金管理人的股东
德邦创新资本有限责任公司(“德邦创新”)	基金管理人的子公司

注：基金管理人于 2024 年 2 月 9 日发布公告，西子联合控股有限公司不再为本基金管理人的股东。

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
德邦证券	-	-	3,467,351.21	1.03

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

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回购交易。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 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 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	3,229.34	2.19	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	455,420.82	195,409.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	142,518.46	72,359.20
应支付基金管理人的净管理费	312,902.36	123,050.03

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	91,084.23	39,081.91

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。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

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C	合计
德邦基金	-	20,730.76	20,730.76
德邦证券	-	19,485.20	19,485.20
交通银行	-	6,615.87	6,615.87
合计	-	46,831.83	46,831.83
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C	合计
德邦基金	-	7.30	7.30
德邦证券	-	3.35	3.35
交通银行	-	275.22	275.22
合计	-	285.87	285.87

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 0.25%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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均未发生转融通证券出借业务。

7.4.10.4.2 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均未发生转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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12月31日	
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
基金合同生效日（2020年4月29日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,999,200.00	-
报告期内申购/买入总份额	217,897.08	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,217,097.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	57.7264%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
基金合同生效日（2020年4月29日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,999,200.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,999,200.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	57.2387%	-

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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	2,053,176.83	15,440.34	5,199,702.70	8,303.18

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度末未发生其它关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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的建设，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和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之内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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投资。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	35,047.98	17,678.24
未评级	-	-
合计	35,047.98	17,678.24

注：未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 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。

本基金所持的所有证券均在证券交易所交易，因此，除附注 7.4.12 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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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							
货币资金	2,053,176.83	-	-	-	-	-	2,053,176.83
结算备付金	1,881,703.69	-	-	-	-	-	1,881,703.69
存出保证金	1,915,808.67	-	-	-	-	-	1,915,808.67
交易性金融资产	-	-	35,047.98	-	-	17,158,452.41	17,193,500.39
应收申购款	-	-	-	-	-	130.00	130.00
资产总计	5,850,689.19	-	35,047.98	-	-	17,158,582.41	23,044,319.58
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	23,169.37	23,169.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	19,821.28	19,821.28
应付托管费	-	-	-	-	-	3,964.24	3,964.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,506.72	1,506.72
其他负债	-	-	-	-	-	94,342.03	94,342.03
负债总计	-	-	-	-	-	142,803.64	142,803.64
利率敏感度缺口	5,850,689.19	-	35,047.98	-	-	17,015,778.77	22,901,515.94
上年度末 2022年12月31日							
资产							
货币资金	5,199,702.70	-	-	-	-	-	5,199,702.70
结算备付金	1,738,174.68	-	-	-	-	-	1,738,174.68
存出保证金	1,791,854.13	-	-	-	-	-	1,791,854.13
交易性金融资产	-	-	-	-	17,678.24	13,086,929.21	13,104,607.45
应收申购款	-	-	-	-	-	7,850.42	7,850.42
资产总计	8,729,731.51	-	-	-	17,678.24	13,094,779.63	21,842,189.38
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	31,814.53	31,814.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,075.96	17,075.96
应付托管费	-	-	-	-	-	3,415.21	3,415.21
应付清算款	-	-	-	-	-	1,621,712.41	1,621,712.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	875.24	875.24

其他负债	-	-	-	-	61,224.20	61,224.20
负债总计	-	-	-	-	1,736,117.55	1,736,117.55
利率敏感度缺口	8,729,731.51	-	-	-17,678.24	11,358,662.08	20,106,071.83

注：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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金持有交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.15%（2022 年 12 月 31 日：0.09%），银行存款、结算备付金以及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）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	17,158,452.41	74.92	13,086,929.21	65.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	35,047.98	0.15	17,678.24	0.09
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	17,193,500.39	75.08	13,104,607.45	65.18
----	---------------	-------	---------------	-------

注：本基金权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占基金资产净值比例范围 0%-10%。本基金投资于银行存款和同业存单的比例合计不超过基金资产的 20%。每个交易日日终，本基金持有的买入期货合约和有价值证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的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、存出保证金和应收申购款等。

7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	沪深300上升1%	3,870.66	18,266.48
	沪深300下降1%	-3,870.66	-18,266.48

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	17,193,500.39	13,104,607.45
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	17,193,500.39	13,104,607.45

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4.9 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”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	17,158,452.41	74.46
	其中：股票	17,158,452.41	74.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,047.98	0.15
	其中：债券	35,047.98	0.15
	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	3,934,880.52	17.08
8	其他各项资产	1,915,938.67	8.31
9	合计	23,044,319.58	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	86,094.00	0.38
B	采矿业	1,058,238.00	4.62
C	制造业	10,171,982.41	44.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	573,491.00	2.50
E	建筑业	359,176.00	1.57
F	批发和零售业	309,469.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	607,944.00	2.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,735,820.00	7.58
J	金融业	1,378,711.00	6.02
K	房地产业	264,568.00	1.16
L	租赁和商务服务业	96,151.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	270,100.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	58,288.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,626.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	172,794.00	0.75
S	综合	-	-
	合计	17,158,452.41	74.92

8.2.2 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。

8.3 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	600519	贵州茅台	100	172,600.00	0.75
2	600252	中恒集团	59,100	148,341.00	0.65
3	000528	柳工	22,000	148,280.00	0.65
4	003012	东鹏控股	17,900	147,675.00	0.64
5	002544	普天科技	7,200	146,304.00	0.64
6	002390	信邦制药	30,800	136,752.00	0.60
7	600572	康恩贝	26,400	133,320.00	0.58
8	002274	华昌化工	17,400	131,370.00	0.57
9	601918	新集能源	23,300	122,791.00	0.54
10	300750	宁德时代	740	120,812.40	0.53
11	000823	超声电子	12,500	119,625.00	0.52
12	002851	麦格米特	4,700	115,620.00	0.50
13	600420	国药现代	11,600	113,564.00	0.50
14	688066	航天宏图	2,600	109,824.00	0.48
15	688578	艾力斯	2,600	108,316.00	0.47
16	000885	城发环境	9,400	106,596.00	0.47
17	600176	中国巨石	10,600	104,198.00	0.45
18	688031	星环科技	1,600	104,112.00	0.45
19	002318	久立特材	5,200	103,376.00	0.45
20	688128	中国电研	4,900	100,548.00	0.44
21	601985	中国核电	13,400	100,500.00	0.44
22	601939	建设银行	15,300	99,603.00	0.43
23	300702	天宇股份	4,500	97,695.00	0.43
24	002003	伟星股份	9,000	97,650.00	0.43
25	000902	新洋丰	8,500	96,815.00	0.42
26	300741	华宝股份	4,500	96,345.00	0.42
27	603920	世运电路	5,200	95,056.00	0.42
28	601899	紫金矿业	7,600	94,696.00	0.41
29	600900	长江电力	4,000	93,360.00	0.41
30	002283	天润工业	15,800	92,430.00	0.40
31	300696	爱乐达	5,300	92,273.00	0.40
32	688330	宏力达	3,200	90,912.00	0.40
33	601006	大秦铁路	12,200	87,962.00	0.38
34	601398	工商银行	18,400	87,952.00	0.38
35	301200	大族数控	2,300	86,871.00	0.38
36	300319	麦捷科技	8,800	84,832.00	0.37
37	603599	广信股份	5,800	84,100.00	0.37

38	601857	中国石油	11,900	84,014.00	0.37
39	600938	中国海油	4,000	83,880.00	0.37
40	002475	立讯精密	2,400	82,680.00	0.36
41	600728	佳都科技	14,400	82,368.00	0.36
42	000338	潍柴动力	6,000	81,900.00	0.36
43	000426	兴业银锡	9,000	81,720.00	0.36
44	002891	中宠股份	3,100	81,685.00	0.36
45	300887	谱尼测试	6,900	81,489.00	0.36
46	688048	长光华芯	1,300	81,471.00	0.36
47	600643	爱建集团	15,900	81,090.00	0.35
48	603132	金徽股份	5,900	80,712.00	0.35
49	002212	天融信	8,100	79,218.00	0.35
50	000685	中山公用	10,700	78,217.00	0.34
51	601989	中国重工	18,900	78,057.00	0.34
52	603118	共进股份	8,700	77,952.00	0.34
53	300973	立高食品	1,600	77,680.00	0.34
54	300294	博雅生物	2,300	77,464.00	0.34
55	000969	安泰科技	8,600	77,314.00	0.34
56	688152	麒麟信安	1,100	77,077.00	0.34
57	300470	中密控股	2,000	75,600.00	0.33
58	601288	农业银行	20,700	75,348.00	0.33
59	600887	伊利股份	2,800	74,900.00	0.33
60	600273	嘉化能源	8,700	74,733.00	0.33
61	002320	海峡股份	12,800	74,624.00	0.33
62	002714	牧原股份	1,800	74,124.00	0.32
63	600908	无锡银行	14,600	73,730.00	0.32
64	000061	农产品	11,300	73,111.00	0.32
65	002415	海康威视	2,100	72,912.00	0.32
66	002128	电投能源	5,100	72,777.00	0.32
67	601088	中国神华	2,300	72,105.00	0.31
68	000612	焦作万方	12,500	71,875.00	0.31
69	002130	沃尔核材	9,500	71,725.00	0.31
70	000333	美的集团	1,300	71,019.00	0.31
71	000100	TCL 科技	16,400	70,520.00	0.31
72	601766	中国中车	13,400	70,484.00	0.31
73	301286	侨源股份	2,400	69,744.00	0.30
74	600389	江山股份	4,000	69,600.00	0.30
75	601988	中国银行	17,100	68,229.00	0.30
76	002001	新和成	4,000	67,840.00	0.30
77	000036	华联控股	17,400	67,686.00	0.30
78	688261	东微半导	800	66,872.00	0.29
79	003006	百亚股份	4,400	66,704.00	0.29
80	601222	林洋能源	10,400	66,456.00	0.29

81	600919	江苏银行	9,800	65,562.00	0.29
82	603071	物产环能	4,300	65,360.00	0.29
83	002517	恺英网络	5,800	64,786.00	0.28
84	600363	联创光电	1,900	64,600.00	0.28
85	600710	苏美达	9,100	64,519.00	0.28
86	002453	华软科技	5,700	64,410.00	0.28
87	001696	宗申动力	9,700	64,311.00	0.28
88	601801	皖新传媒	9,200	63,940.00	0.28
89	300894	火星人	3,900	63,336.00	0.28
90	600986	浙文互联	11,600	63,336.00	0.28
91	002421	达实智能	19,600	63,112.00	0.28
92	603328	依顿电子	7,600	61,940.00	0.27
93	002091	江苏国泰	7,900	61,857.00	0.27
94	002065	东华软件	10,000	61,700.00	0.27
95	601702	华峰铝业	3,400	61,030.00	0.27
96	000791	甘肃能源	10,800	60,156.00	0.26
97	000901	航天科技	6,400	59,648.00	0.26
98	600971	恒源煤电	5,300	59,095.00	0.26
99	000166	申万宏源	13,300	59,052.00	0.26
100	600711	盛屯矿业	13,600	59,024.00	0.26
101	300760	迈瑞医疗	200	58,120.00	0.25
102	688333	铂力特	500	57,950.00	0.25
103	000928	中钢国际	9,800	57,134.00	0.25
104	601168	西部矿业	4,000	57,080.00	0.25
105	601816	京沪高铁	11,600	57,072.00	0.25
106	600660	福耀玻璃	1,500	56,085.00	0.24
107	002405	四维图新	6,300	56,070.00	0.24
108	000681	视觉中国	3,800	55,860.00	0.24
109	600015	华夏银行	9,800	55,076.00	0.24
110	600531	豫光金铅	9,000	54,450.00	0.24
111	601319	中国人保	11,200	54,208.00	0.24
112	000157	中联重科	8,300	54,199.00	0.24
113	000088	盐田港	11,100	54,168.00	0.24
114	688711	宏微科技	1,300	53,937.00	0.24
115	002745	木林森	6,200	53,692.00	0.23
116	002950	奥美医疗	5,600	53,088.00	0.23
117	603609	禾丰股份	6,200	53,072.00	0.23
118	603083	剑桥科技	1,400	52,808.00	0.23
119	600019	宝钢股份	8,900	52,777.00	0.23
120	600160	巨化股份	3,200	52,768.00	0.23
121	002174	游族网络	4,600	52,716.00	0.23
122	000950	重药控股	10,500	52,185.00	0.23
123	000686	东北证券	7,300	51,830.00	0.23

124	601390	中国中铁	9,000	51,120.00	0.22
125	000725	京东方 A	13,100	51,090.00	0.22
126	601728	中国电信	9,400	50,854.00	0.22
127	600267	海正药业	5,400	50,544.00	0.22
128	000090	天健集团	10,800	49,680.00	0.22
129	002287	奇正藏药	2,200	49,478.00	0.22
130	601718	际华集团	17,400	49,416.00	0.22
131	688728	格科微	2,400	49,128.00	0.21
132	002191	劲嘉股份	9,100	48,867.00	0.21
133	000910	大亚圣象	6,100	48,800.00	0.21
134	600211	西藏药业	1,000	48,800.00	0.21
135	601318	中国平安	1,200	48,360.00	0.21
136	600612	老凤祥	700	48,300.00	0.21
137	000895	双汇发展	1,800	48,078.00	0.21
138	600285	羚锐制药	2,800	47,908.00	0.21
139	002032	苏泊尔	900	47,709.00	0.21
140	601601	中国太保	2,000	47,560.00	0.21
141	600663	陆家嘴	5,400	47,250.00	0.21
142	002651	利君股份	6,800	47,056.00	0.21
143	603060	国检集团	5,600	47,040.00	0.21
144	300012	华测检测	3,300	46,860.00	0.20
145	002028	思源电气	900	46,836.00	0.20
146	002746	仙坛股份	6,600	46,464.00	0.20
147	603279	景津装备	2,100	46,431.00	0.20
148	600760	中航沈飞	1,100	46,398.00	0.20
149	002233	塔牌集团	6,500	46,020.00	0.20
150	002085	万丰奥威	9,300	45,942.00	0.20
151	300639	凯普生物	4,900	45,766.00	0.20
152	002139	拓邦股份	4,600	44,896.00	0.20
153	601108	财通证券	5,700	44,232.00	0.19
154	300271	华宇软件	5,400	44,226.00	0.19
155	600377	宁沪高速	4,300	44,075.00	0.19
156	000555	神州信息	3,900	44,031.00	0.19
157	603601	再升科技	10,200	43,860.00	0.19
158	688676	金盘科技	1,200	42,996.00	0.19
159	000990	诚志股份	5,200	42,692.00	0.19
160	603896	寿仙谷	1,300	41,912.00	0.18
161	601186	中国铁建	5,500	41,855.00	0.18
162	002434	万里扬	5,600	41,720.00	0.18
163	002498	汉缆股份	10,400	41,600.00	0.18
164	002439	启明星辰	1,500	40,500.00	0.18
165	601658	邮储银行	9,300	40,455.00	0.18
166	002226	江南化工	9,200	40,296.00	0.18

167	300379	东方通	2,200	40,216.00	0.18
168	600782	新钢股份	11,500	40,135.00	0.18
169	601921	浙版传媒	5,200	39,728.00	0.17
170	300358	楚天科技	3,700	39,590.00	0.17
171	603323	苏农银行	9,500	39,520.00	0.17
172	600225	卓朗科技	10,300	39,140.00	0.17
173	600845	宝信软件	800	39,040.00	0.17
174	002815	崇达技术	4,000	38,320.00	0.17
175	601963	重庆银行	5,500	38,280.00	0.17
176	000425	徐工机械	7,000	38,220.00	0.17
177	002203	海亮股份	3,400	37,910.00	0.17
178	603983	丸美股份	1,500	37,905.00	0.17
179	603533	掌阅科技	1,900	37,772.00	0.16
180	002422	科伦药业	1,300	37,765.00	0.16
181	601688	华泰证券	2,700	37,665.00	0.16
182	003816	中国广核	11,900	37,009.00	0.16
183	688660	电气风电	7,200	37,008.00	0.16
184	603229	奥翔药业	2,800	36,988.00	0.16
185	000938	紫光股份	1,900	36,765.00	0.16
186	600018	上港集团	7,500	36,750.00	0.16
187	600935	华塑股份	10,900	36,733.00	0.16
188	600649	城投控股	9,900	36,630.00	0.16
189	002589	瑞康医药	11,200	36,624.00	0.16
190	002446	盛路通信	4,400	36,520.00	0.16
191	600406	国电南瑞	1,600	35,712.00	0.16
192	603881	数据港	1,800	35,676.00	0.16
193	601609	金田股份	5,200	35,204.00	0.15
194	002202	金风科技	4,400	35,200.00	0.15
195	001872	招商港口	2,200	35,112.00	0.15
196	002015	协鑫能科	2,800	34,664.00	0.15
197	002429	兆驰股份	6,200	34,596.00	0.15
198	600217	中再资环	7,800	34,164.00	0.15
199	000060	中金岭南	7,900	34,128.00	0.15
200	000811	冰轮环境	2,500	33,925.00	0.15
201	002056	横店东磁	2,500	33,850.00	0.15
202	688389	普门科技	1,500	33,765.00	0.15
203	300298	三诺生物	1,100	33,440.00	0.15
204	000951	中国重汽	2,500	33,400.00	0.15
205	002158	汉钟精机	1,500	33,390.00	0.15
206	001979	招商蛇口	3,500	33,355.00	0.15
207	300170	汉得信息	4,000	33,240.00	0.15
208	600633	浙数文化	3,000	33,180.00	0.14
209	002064	华峰化学	4,900	32,879.00	0.14

210	300451	创业慧康	5,000	32,750.00	0.14
211	603098	森特股份	2,400	32,664.00	0.14
212	600582	天地科技	6,000	32,640.00	0.14
213	600888	新疆众和	4,500	32,580.00	0.14
214	000932	华菱钢铁	6,300	32,445.00	0.14
215	002436	兴森科技	2,200	32,406.00	0.14
216	000848	承德露露	4,100	32,185.00	0.14
217	002004	华邦健康	6,900	32,154.00	0.14
218	000627	天茂集团	11,300	32,092.00	0.14
219	002724	海洋王	3,900	32,058.00	0.14
220	601399	国机重装	11,300	31,979.00	0.14
221	600210	紫江企业	6,800	31,960.00	0.14
222	600315	上海家化	1,500	31,770.00	0.14
223	600372	中航机载	2,400	31,632.00	0.14
224	601838	成都银行	2,800	31,528.00	0.14
225	601077	渝农商行	7,700	31,416.00	0.14
226	688278	特宝生物	600	31,410.00	0.14
227	600064	南京高科	5,200	31,408.00	0.14
228	002807	江阴银行	8,800	31,240.00	0.14
229	600717	天津港	7,600	31,236.00	0.14
230	600096	云天化	2,000	31,200.00	0.14
231	600098	广州发展	5,800	31,146.00	0.14
232	300856	科思股份	500	31,115.00	0.14
233	688275	万润新能	500	30,835.00	0.13
234	600490	鹏欣资源	10,300	30,797.00	0.13
235	600030	中信证券	1,500	30,555.00	0.13
236	688700	东威科技	500	30,510.00	0.13
237	002034	旺能环境	2,000	30,500.00	0.13
238	000878	云南铜业	2,800	30,492.00	0.13
239	300638	广和通	1,600	30,448.00	0.13
240	600797	浙大网新	4,600	30,176.00	0.13
241	600584	长电科技	1,000	29,860.00	0.13
242	002185	华天科技	3,500	29,820.00	0.13
243	000423	东阿阿胶	600	29,592.00	0.13
244	600166	福田汽车	10,800	29,484.00	0.13
245	300284	苏交科	5,400	29,430.00	0.13
246	300765	新诺威	800	29,296.00	0.13
247	600248	陕建股份	7,200	28,944.00	0.13
248	002204	大连重工	6,300	28,791.00	0.13
249	688239	航宇科技	600	28,662.00	0.13
250	002048	宁波华翔	2,200	28,622.00	0.12
251	300080	易成新能	5,900	28,556.00	0.12
252	300323	华灿光电	3,900	28,548.00	0.12

253	300002	神州泰岳	3,200	28,320.00	0.12
254	600298	安琪酵母	800	28,144.00	0.12
255	600989	宝丰能源	1,900	28,063.00	0.12
256	000858	五粮液	200	28,062.00	0.12
257	600025	华能水电	3,200	27,616.00	0.12
258	002145	中核钛白	6,100	27,328.00	0.12
259	300377	赢时胜	3,500	27,160.00	0.12
260	300296	利亚德	4,500	27,000.00	0.12
261	600489	中金黄金	2,700	26,892.00	0.12
262	300777	中简科技	900	26,847.00	0.12
263	688303	大全能源	900	26,613.00	0.12
264	601881	中国银河	2,200	26,510.00	0.12
265	603979	金诚信	700	26,432.00	0.12
266	300332	天壕能源	3,300	26,235.00	0.11
267	600398	海澜之家	3,500	25,970.00	0.11
268	600707	彩虹股份	3,800	25,650.00	0.11
269	002967	广电计量	1,700	25,517.00	0.11
270	300109	新开源	1,400	25,256.00	0.11
271	300036	超图软件	1,200	25,080.00	0.11
272	300679	电连技术	600	24,900.00	0.11
273	600502	安徽建工	5,300	24,645.00	0.11
274	000513	丽珠集团	700	24,507.00	0.11
275	300001	特锐德	1,200	24,120.00	0.11
276	601877	正泰电器	1,100	23,661.00	0.10
277	600329	达仁堂	700	23,555.00	0.10
278	000915	华特达因	800	23,168.00	0.10
279	601169	北京银行	5,100	23,103.00	0.10
280	603300	华铁应急	3,600	23,040.00	0.10
281	605090	九丰能源	800	22,344.00	0.10
282	600104	上汽集团	1,600	21,648.00	0.09
283	600312	平高电气	1,700	21,573.00	0.09
284	600085	同仁堂	400	21,480.00	0.09
285	600403	大有能源	5,600	21,280.00	0.09
286	688277	天智航	1,600	21,088.00	0.09
287	601101	昊华能源	3,300	20,856.00	0.09
288	300166	东方国信	2,200	20,680.00	0.09
289	002567	唐人神	2,700	20,250.00	0.09
290	002683	广东宏大	1,000	20,080.00	0.09
291	300433	蓝思科技	1,500	19,800.00	0.09
292	000538	云南白药	400	19,660.00	0.09
293	000881	中广核技	2,700	19,575.00	0.09
294	688029	南微医学	200	19,360.00	0.08
295	002435	长江健康	4,600	19,182.00	0.08

296	603195	公牛集团	200	19,130.00	0.08
297	600926	杭州银行	1,900	19,019.00	0.08
298	000761	本钢板材	5,300	18,921.00	0.08
299	600050	中国联通	4,300	18,834.00	0.08
300	603113	金能科技	2,300	18,561.00	0.08
301	601111	中国国航	2,500	18,350.00	0.08
302	605123	派克新材	200	18,240.00	0.08
303	000568	泸州老窖	100	17,942.00	0.08
304	601901	方正证券	2,200	17,732.00	0.08
305	002007	华兰生物	800	17,704.00	0.08
306	600875	东方电气	1,200	17,544.00	0.08
307	600873	梅花生物	1,800	17,190.00	0.08
308	002266	浙富控股	5,000	17,000.00	0.07
309	000739	普洛药业	1,100	16,929.00	0.07
310	601607	上海医药	1,000	16,730.00	0.07
311	601800	中国交建	2,200	16,720.00	0.07
312	002558	巨人网络	1,500	16,710.00	0.07
313	601138	工业富联	1,100	16,632.00	0.07
314	002378	章源钨业	2,900	16,414.00	0.07
315	600867	通化东宝	1,500	16,245.00	0.07
316	002901	大博医疗	400	16,236.00	0.07
317	000559	万向钱潮	3,100	16,089.00	0.07
318	002911	佛燃能源	1,400	16,044.00	0.07
319	600299	安迪苏	2,000	16,000.00	0.07
320	300485	赛升药业	1,500	15,885.00	0.07
321	001289	龙源电力	800	15,848.00	0.07
322	002044	美年健康	2,600	15,626.00	0.07
323	600863	内蒙华电	4,000	15,600.00	0.07
324	600901	江苏金租	3,200	15,488.00	0.07
325	601058	赛轮轮胎	1,300	15,275.00	0.07
326	000728	国元证券	2,200	15,026.00	0.07
327	600438	通威股份	600	15,018.00	0.07
328	600600	青岛啤酒	200	14,950.00	0.07
329	600023	浙能电力	3,200	14,752.00	0.06
330	600320	振华重工	4,400	14,608.00	0.06
331	000661	长春高新	100	14,580.00	0.06
332	603235	天新药业	600	14,424.00	0.06
333	601919	中远海控	1,500	14,370.00	0.06
334	300634	彩讯股份	700	14,329.00	0.06
335	000937	冀中能源	2,000	14,280.00	0.06
336	002916	深南电路	200	14,198.00	0.06
337	688041	海光信息	200	14,196.00	0.06
338	600645	中源协和	700	14,189.00	0.06

339	301090	华润材料	1,300	14,118.00	0.06
340	002215	诺普信	1,700	14,042.00	0.06
341	601668	中国建筑	2,900	13,949.00	0.06
342	688133	泰坦科技	300	13,905.00	0.06
343	000039	中集集团	1,800	13,770.00	0.06
344	002831	裕同科技	500	13,755.00	0.06
345	600295	鄂尔多斯	1,400	13,580.00	0.06
346	601878	浙商证券	1,300	13,559.00	0.06
347	000156	华数传媒	1,800	13,266.00	0.06
348	601699	潞安环能	600	13,146.00	0.06
349	688148	芳源股份	1,703	13,062.01	0.06
350	002585	双星新材	1,600	12,976.00	0.06
351	002249	大洋电机	2,600	12,922.00	0.06
352	600587	新华医疗	500	12,895.00	0.06
353	000651	格力电器	400	12,868.00	0.06
354	000983	山西焦煤	1,300	12,844.00	0.06
355	300124	汇川技术	200	12,628.00	0.06
356	601598	中国外运	2,400	12,576.00	0.05
357	605388	均瑶健康	1,000	12,540.00	0.05
358	601225	陕西煤业	600	12,534.00	0.05
359	600569	安阳钢铁	5,800	12,354.00	0.05
360	600999	招商证券	900	12,276.00	0.05
361	603301	振德医疗	500	12,250.00	0.05
362	600058	五矿发展	1,300	12,194.00	0.05
363	600598	北大荒	1,000	11,970.00	0.05
364	000988	华工科技	400	11,904.00	0.05
365	000503	国新健康	900	11,862.00	0.05
366	002019	亿帆医药	800	11,824.00	0.05
367	601156	东航物流	800	11,824.00	0.05
368	000733	振华科技	200	11,768.00	0.05
369	688315	诺禾致源	500	11,670.00	0.05
370	601333	广深铁路	4,500	11,655.00	0.05
371	600740	山西焦化	2,300	11,592.00	0.05
372	000089	深圳机场	1,800	11,574.00	0.05
373	002706	良信股份	1,300	11,479.00	0.05
374	601995	中金公司	300	11,415.00	0.05
375	000688	国城矿业	1,100	11,341.00	0.05
376	002938	鹏鼎控股	500	11,160.00	0.05
377	000630	铜陵有色	3,400	11,152.00	0.05
378	002063	远光软件	1,800	11,124.00	0.05
379	002152	广电运通	900	11,034.00	0.05
380	002304	洋河股份	100	10,990.00	0.05
381	600183	生益科技	600	10,986.00	0.05

382	000636	风华高科	800	10,928.00	0.05
383	601200	上海环境	1,200	10,788.00	0.05
384	600959	江苏有线	3,400	10,676.00	0.05
385	601898	中煤能源	1,100	10,659.00	0.05
386	688981	中芯国际	200	10,604.00	0.05
387	300979	华利集团	200	10,528.00	0.05
388	600039	四川路桥	1,400	10,486.00	0.05
389	002695	煌上煌	1,000	10,470.00	0.05
390	002252	上海莱士	1,300	10,400.00	0.05
391	600478	科力远	2,100	10,332.00	0.05
392	600219	南山铝业	3,500	10,290.00	0.04
393	603636	南威软件	800	10,256.00	0.04
394	601952	苏垦农发	1,000	10,240.00	0.04
395	600718	东软集团	1,100	10,175.00	0.04
396	603369	今世缘	200	9,750.00	0.04
397	603718	海利生物	900	9,639.00	0.04
398	600639	浦东金桥	900	9,099.00	0.04
399	002311	海大集团	200	8,982.00	0.04
400	688088	虹软科技	200	8,208.00	0.04
401	300841	康华生物	100	7,754.00	0.03

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	3,202,158.00	15.93
2	000725	京东方 A	3,097,812.00	15.41
3	002371	北方华创	3,036,917.72	15.10
4	000858	五粮液	2,501,646.00	12.44
5	601318	中国平安	2,490,011.00	12.38
6	688111	金山办公	2,487,895.61	12.37
7	601728	中国电信	2,351,987.00	11.70
8	300896	爱美客	2,333,279.00	11.60
9	000100	TCL 科技	2,134,664.00	10.62
10	300058	蓝色光标	2,106,084.00	10.47
11	000540	*ST 中天	2,069,186.00	10.29
12	000568	泸州老窖	2,067,430.00	10.28
13	603613	国联股份	2,052,900.00	10.21
14	002463	沪电股份	2,028,592.60	10.09
15	300763	锦浪科技	1,989,952.00	9.90
16	002600	领益智造	1,959,784.00	9.75
17	300832	新产业	1,887,915.00	9.39
18	000651	格力电器	1,867,434.00	9.29

19	603605	珀莱雅	1,839,699.00	9.15
20	688390	固德威	1,830,554.23	9.10
21	002422	科伦药业	1,805,997.00	8.98
22	002594	比亚迪	1,803,341.00	8.97
23	000988	华工科技	1,800,380.00	8.95
24	688012	中微公司	1,783,478.84	8.87
25	000818	航锦科技	1,777,666.00	8.84
26	002475	立讯精密	1,751,973.00	8.71
27	600519	贵州茅台	1,732,057.00	8.61
28	002292	奥飞娱乐	1,708,186.00	8.50
29	300762	上海瀚讯	1,703,840.84	8.47
30	688063	派能科技	1,693,612.35	8.42
31	300024	机器人	1,682,671.00	8.37
32	002236	大华股份	1,669,570.00	8.30
33	300860	锋尚文化	1,668,134.00	8.30
34	300033	同花顺	1,641,837.00	8.17
35	601012	隆基绿能	1,619,563.00	8.06
36	300130	新国都	1,612,571.00	8.02
37	002466	天齐锂业	1,602,361.00	7.97
38	601816	京沪高铁	1,591,174.00	7.91
39	300014	亿纬锂能	1,565,960.00	7.79
40	601398	工商银行	1,551,173.00	7.71
41	601333	广深铁路	1,549,498.00	7.71
42	002368	太极股份	1,480,771.32	7.36
43	300059	东方财富	1,473,119.00	7.33
44	688188	柏楚电子	1,467,005.52	7.30
45	605499	东鹏饮料	1,466,092.00	7.29
46	601929	吉视传媒	1,461,951.00	7.27
47	003021	兆威机电	1,458,967.00	7.26
48	601138	工业富联	1,434,556.00	7.13
49	002421	达实智能	1,434,447.00	7.13
50	688202	美迪西	1,426,519.19	7.09
51	002027	分众传媒	1,417,492.00	7.05
52	300133	华策影视	1,416,454.00	7.04
53	002352	顺丰控股	1,411,884.00	7.02
54	300394	天孚通信	1,408,815.00	7.01
55	300170	汉得信息	1,407,610.00	7.00
56	600016	民生银行	1,404,064.00	6.98
57	000425	徐工机械	1,387,075.00	6.90
58	300229	拓尔思	1,349,816.00	6.71
59	003816	中国广核	1,338,112.00	6.66
60	000063	中兴通讯	1,336,740.00	6.65
61	601989	中国重工	1,332,902.00	6.63

62	601288	农业银行	1,308,866.00	6.51
63	300390	天华新能	1,307,881.00	6.50
64	300502	新易盛	1,289,611.00	6.41
65	601958	金铂股份	1,288,348.00	6.41
66	002017	东信和平	1,280,799.00	6.37
67	300308	中际旭创	1,274,387.00	6.34
68	002085	万丰奥威	1,270,847.00	6.32
69	300474	景嘉微	1,260,506.00	6.27
70	600050	中国联通	1,259,640.00	6.26
71	300476	胜宏科技	1,257,032.00	6.25
72	688100	威胜信息	1,255,729.97	6.25
73	002174	游族网络	1,237,430.00	6.15
74	300115	长盈精密	1,234,615.00	6.14
75	000932	华菱钢铁	1,229,614.00	6.12
76	300765	新诺威	1,221,034.94	6.07
77	600331	宏达股份	1,219,407.00	6.06
78	300634	彩讯股份	1,214,305.00	6.04
79	000338	潍柴动力	1,212,978.00	6.03
80	600369	西南证券	1,212,972.00	6.03
81	601162	天风证券	1,211,629.00	6.03
82	600900	长江电力	1,205,556.00	6.00
83	603379	三美股份	1,199,086.00	5.96
84	601997	贵阳银行	1,177,317.00	5.86
85	002738	中矿资源	1,175,786.00	5.85
86	605117	德业股份	1,168,308.00	5.81
87	300900	广联航空	1,163,111.00	5.78
88	002459	晶澳科技	1,162,129.00	5.78
89	002063	远光软件	1,160,819.98	5.77
90	601899	紫金矿业	1,159,836.00	5.77
91	600246	万通发展	1,158,709.00	5.76
92	688127	蓝特光学	1,154,502.00	5.74
93	688321	微芯生物	1,153,298.79	5.74
94	688578	艾力斯	1,152,894.87	5.73
95	603000	人民网	1,147,907.00	5.71
96	600928	西安银行	1,142,768.00	5.68
97	600958	东方证券	1,134,854.00	5.64
98	603993	洛阳钼业	1,128,492.00	5.61
99	600996	贵广网络	1,123,513.00	5.59
100	601319	中国人保	1,120,648.00	5.57
101	600871	石化油服	1,119,139.00	5.57
102	688330	宏力达	1,115,283.22	5.55
103	601628	中国人寿	1,110,855.00	5.52
104	000563	陕国投 A	1,106,954.00	5.51

105	003035	南网能源	1,106,884.00	5.51
106	300910	瑞丰新材	1,103,811.00	5.49
107	300760	迈瑞医疗	1,090,703.00	5.42
108	002217	合力泰	1,088,323.00	5.41
109	002351	漫步者	1,078,962.00	5.37
110	000598	兴蓉环境	1,073,424.00	5.34
111	600901	江苏金租	1,068,604.00	5.31
112	002517	恺英网络	1,068,484.00	5.31
113	688639	华恒生物	1,059,514.20	5.27
114	002460	赣锋锂业	1,048,216.04	5.21
115	603328	依顿电子	1,039,303.00	5.17
116	000690	宝新能源	1,032,580.50	5.14
117	300251	光线传媒	1,030,034.00	5.12
118	002867	周大生	1,016,727.00	5.06
119	000426	兴业银锡	1,012,535.00	5.04
120	600547	山东黄金	1,009,730.00	5.02
121	601988	中国银行	1,008,168.00	5.01
122	002415	海康威视	1,005,794.00	5.00
123	000048	京基智农	1,003,668.00	4.99
124	603599	广信股份	983,374.00	4.89
125	688700	东威科技	983,106.08	4.89
126	600036	招商银行	972,415.00	4.84
127	000937	冀中能源	971,288.00	4.83
128	300054	鼎龙股份	970,393.00	4.83
129	600959	江苏有线	967,095.00	4.81
130	002065	东华软件	966,968.00	4.81
131	688001	华兴源创	964,514.28	4.80
132	300455	航天智装	962,202.00	4.79
133	002291	遥望科技	956,404.00	4.76
134	300357	我武生物	954,997.00	4.75
135	300253	卫宁健康	954,245.00	4.75
136	601077	渝农商行	941,154.00	4.68
137	601668	中国建筑	938,347.00	4.67
138	688521	芯原股份	935,427.87	4.65
139	601231	环旭电子	922,863.00	4.59
140	000021	深科技	916,483.00	4.56
141	688617	惠泰医疗	915,463.00	4.55
142	002020	京新药业	915,103.00	4.55
143	002230	科大讯飞	913,013.00	4.54
144	688777	中控技术	909,258.07	4.52
145	300751	迈为股份	903,958.00	4.50
146	688981	中芯国际	900,604.39	4.48
147	688277	天智航	899,417.19	4.47

148	601857	中国石油	898,373.00	4.47
149	300001	特锐德	895,735.00	4.46
150	688158	优刻得	886,413.38	4.41
151	300363	博腾股份	885,484.00	4.40
152	002252	上海莱士	881,689.00	4.39
153	002409	雅克科技	873,864.00	4.35
154	002318	久立特材	871,198.00	4.33
155	002215	诺普信	866,993.00	4.31
156	300628	亿联网络	864,466.00	4.30
157	002741	光华科技	864,392.00	4.30
158	300525	博思软件	861,433.00	4.28
159	300856	科思股份	861,116.00	4.28
160	300274	阳光电源	859,174.00	4.27
161	000002	万科A	856,561.00	4.26
162	603108	润达医疗	856,132.00	4.26
163	002979	雷赛智能	852,371.00	4.24
164	002714	牧原股份	850,760.00	4.23
165	002803	吉宏股份	847,304.00	4.21
166	600223	福瑞达	839,829.00	4.18
167	002088	鲁阳节能	837,457.00	4.17
168	600415	小商品城	822,378.00	4.09
169	688116	天奈科技	819,689.15	4.08
170	688586	江航装备	818,226.61	4.07
171	600971	恒源煤电	807,344.00	4.02
172	688256	寒武纪	807,312.03	4.02
173	002129	TCL中环	806,175.44	4.01
174	002276	万马股份	804,027.00	4.00
175	600572	康恩贝	790,920.00	3.93
176	688499	利元亨	789,466.96	3.93
177	300009	安科生物	778,513.00	3.87
178	002865	钧达股份	778,312.00	3.87
179	600030	中信证券	775,316.00	3.86
180	600845	宝信软件	773,972.00	3.85
181	003031	中瓷电子	771,224.00	3.84
182	601186	中国铁建	767,888.00	3.82
183	688680	海优新材	760,422.53	3.78
184	300151	昌红科技	755,459.00	3.76
185	000851	高鸿股份	744,891.73	3.70
186	600309	万华化学	744,831.00	3.70
187	600582	天地科技	739,580.00	3.68
188	000938	紫光股份	738,780.00	3.67
189	600089	特变电工	735,839.00	3.66
190	603105	芯能科技	729,776.00	3.63

191	600276	恒瑞医药	729,707.00	3.63
192	300035	中科电气	728,154.00	3.62
193	601868	中国能建	727,788.00	3.62
194	600879	航天电子	726,802.00	3.61
195	300607	拓斯达	723,404.00	3.60
196	002028	思源电气	720,715.00	3.58
197	601881	中国银河	719,144.16	3.58
198	300212	易华录	714,735.00	3.55
199	002049	紫光国微	704,589.00	3.50
200	688711	宏微科技	702,451.00	3.49
201	300271	华宇软件	702,238.00	3.49
202	300205	天喻信息	701,988.00	3.49
203	300655	晶瑞电材	699,532.00	3.48
204	601009	南京银行	695,622.00	3.46
205	002697	红旗连锁	690,780.00	3.44
206	300567	精测电子	687,410.00	3.42
207	002179	中航光电	686,111.00	3.41
208	002649	博彦科技	684,737.00	3.41
209	600863	内蒙华电	680,447.00	3.38
210	300723	一品红	679,612.00	3.38
211	000656	金科股份	679,562.00	3.38
212	000560	我爱我家	679,354.00	3.38
213	002683	广东宏大	679,065.00	3.38
214	600380	健康元	677,252.00	3.37
215	601106	中国一重	675,915.00	3.36
216	000933	神火股份	675,901.00	3.36
217	002847	盐津铺子	674,311.00	3.35
218	002034	旺能环境	672,543.00	3.34
219	002400	省广集团	671,590.00	3.34
220	600895	张江高科	666,119.00	3.31
221	300232	洲明科技	663,497.00	3.30
222	000166	申万宏源	662,392.00	3.29
223	300687	赛意信息	660,164.00	3.28
224	300470	中密控股	659,529.00	3.28
225	600667	太极实业	656,922.00	3.27
226	600129	太极集团	655,857.00	3.26
227	300653	正海生物	655,267.00	3.26
228	601939	建设银行	652,410.00	3.24
229	603235	天新药业	648,208.05	3.22
230	301089	拓新药业	647,024.00	3.22
231	000961	中南建设	645,258.00	3.21
232	002317	众生药业	641,130.00	3.19
233	300168	万达信息	640,063.00	3.18

234	688017	绿的谐波	639,689.06	3.18
235	300451	创业慧康	638,901.00	3.18
236	300015	爱尔眼科	636,340.00	3.16
237	600028	中国石化	634,604.00	3.16
238	002993	奥海科技	633,176.00	3.15
239	000623	吉林敖东	631,429.00	3.14
240	688083	中望软件	630,762.42	3.14
241	300079	数码视讯	628,562.00	3.13
242	301031	中熔电气	622,937.00	3.10
243	000001	平安银行	621,799.00	3.09
244	600039	四川路桥	621,353.00	3.09
245	600438	通威股份	620,779.03	3.09
246	002222	福晶科技	620,754.00	3.09
247	601168	西部矿业	620,237.00	3.08
248	002739	万达电影	618,243.00	3.07
249	605507	国邦医药	617,718.00	3.07
250	002832	比音勒芬	617,412.00	3.07
251	002303	美盈森	614,986.00	3.06
252	600909	华安证券	614,643.00	3.06
253	688037	芯源微	613,630.64	3.05
254	601555	东吴证券	609,764.00	3.03
255	600329	达仁堂	608,413.00	3.03
256	603920	世运电路	602,751.08	3.00
257	601166	兴业银行	602,107.00	2.99
258	000630	铜陵有色	600,843.00	2.99
259	601088	中国神华	599,119.00	2.98
260	601600	中国铝业	598,273.00	2.98
261	600570	恒生电子	594,523.59	2.96
262	002372	伟星新材	593,650.00	2.95
263	002056	横店东磁	592,012.00	2.94
264	601688	华泰证券	590,157.04	2.94
265	688088	虹软科技	586,645.23	2.92
266	601888	中国中免	585,871.00	2.91
267	300423	昇辉科技	581,325.00	2.89
268	000950	重药控股	579,846.00	2.88
269	603979	金诚信	578,509.00	2.88
270	600775	南京熊猫	578,465.00	2.88
271	688005	容百科技	577,221.10	2.87
272	603959	百利科技	576,284.00	2.87
273	300661	圣邦股份	576,211.00	2.87
274	000895	双汇发展	576,094.00	2.87
275	605369	拱东医疗	574,737.00	2.86
276	605589	圣泉集团	573,294.00	2.85

277	002851	麦格米特	568,730.00	2.83
278	688800	瑞可达	566,813.95	2.82
279	002991	甘源食品	566,246.00	2.82
280	601198	东兴证券	556,489.00	2.77
281	300761	立华股份	554,895.00	2.76
282	600160	巨化股份	553,309.00	2.75
283	688389	普门科技	549,893.23	2.73
284	300382	斯莱克	549,466.00	2.73
285	601577	长沙银行	547,801.00	2.72
286	688208	道通科技	547,113.04	2.72
287	688148	芳源股份	543,485.72	2.70
288	600025	华能水电	542,267.00	2.70
289	601179	中国西电	542,244.00	2.70
290	000878	云南铜业	541,588.00	2.69
291	600886	国投电力	540,380.00	2.69
292	000681	视觉中国	539,975.00	2.69
293	688009	中国通号	538,190.21	2.68
294	601212	白银有色	536,929.00	2.67
295	000682	东方电子	534,484.00	2.66
296	688262	国芯科技	533,092.72	2.65
297	002838	道恩股份	531,138.00	2.64
298	300487	蓝晓科技	530,439.00	2.64
299	300866	安克创新	528,829.00	2.63
300	600562	国睿科技	525,310.00	2.61
301	002044	美年健康	524,303.00	2.61
302	600742	一汽富维	521,450.00	2.59
303	300672	国科微	521,010.00	2.59
304	600420	国药现代	520,842.00	2.59
305	300638	广和通	516,439.00	2.57
306	600273	嘉化能源	516,308.00	2.57
307	000676	智度股份	514,416.00	2.56
308	300101	振芯科技	513,898.00	2.56
309	002156	通富微电	512,406.00	2.55
310	002344	海宁皮城	512,288.58	2.55
311	002015	协鑫能科	508,877.00	2.53
312	300395	菲利华	508,349.00	2.53
313	600188	兖矿能源	507,898.00	2.53
314	300602	飞荣达	507,836.00	2.53
315	603466	风语筑	506,586.00	2.52
316	000333	美的集团	504,429.00	2.51
317	000652	泰达股份	504,409.00	2.51
318	001227	兰州银行	500,929.00	2.49
319	300080	易成新能	499,427.00	2.48

320	300406	九强生物	497,486.00	2.47
321	300102	乾照光电	494,872.00	2.46
322	601949	中国出版	494,703.00	2.46
323	000567	海德股份	494,585.00	2.46
324	000423	东阿阿胶	493,812.00	2.46
325	000977	浪潮信息	492,071.00	2.45
326	002446	盛路通信	491,941.00	2.45
327	688686	奥普特	490,449.32	2.44
328	002467	二六三	489,782.00	2.44
329	002568	百润股份	489,755.00	2.44
330	601992	金隅集团	487,590.00	2.43
331	002544	普天科技	487,062.00	2.42
332	601169	北京银行	486,900.00	2.42
333	603826	坤彩科技	482,714.00	2.40
334	300319	麦捷科技	477,907.00	2.38
335	601985	中国核电	477,866.00	2.38
336	001979	招商蛇口	477,571.00	2.38
337	002176	江特电机	474,368.00	2.36
338	601658	邮储银行	473,918.00	2.36
339	300777	中简科技	473,235.00	2.35
340	000733	振华科技	466,794.00	2.32
341	002777	久远银海	464,465.00	2.31
342	300418	昆仑万维	462,821.00	2.30
343	603060	国检集团	462,119.00	2.30
344	601279	英利汽车	461,342.00	2.29
345	002698	博实股份	460,116.00	2.29
346	688268	华特气体	460,099.26	2.29
347	002453	华软科技	459,143.00	2.28
348	000708	中信特钢	458,465.00	2.28
349	600363	联创光电	458,442.00	2.28
350	300203	聚光科技	457,954.00	2.28
351	002131	利欧股份	456,344.00	2.27
352	688733	壹石通	456,069.05	2.27
353	300408	三环集团	455,864.00	2.27
354	603612	索通发展	455,327.00	2.26
355	688315	诺禾致源	453,055.89	2.25
356	301029	怡合达	451,769.00	2.25
357	002152	广电运通	451,373.00	2.24
358	000917	电广传媒	449,380.00	2.24
359	002938	鹏鼎控股	448,854.00	2.23
360	688128	中国电研	448,126.05	2.23
361	600131	国网信通	445,140.00	2.21
362	000928	中钢国际	443,326.00	2.20

363	300666	江丰电子	443,243.00	2.20
364	002142	宁波银行	442,513.00	2.20
365	688173	希荻微	442,319.39	2.20
366	300383	光环新网	442,127.00	2.20
367	601799	星宇股份	439,951.00	2.19
368	002436	兴森科技	439,755.00	2.19
369	002130	沃尔核材	438,036.00	2.18
370	605168	三人行	437,167.00	2.17
371	300109	新开源	436,675.00	2.17
372	600335	国机汽车	435,112.00	2.16
373	300456	赛微电子	434,052.00	2.16
374	300149	睿智医药	433,504.00	2.16
375	002219	新里程	432,898.00	2.15
376	601601	中国太保	432,816.00	2.15
377	002583	海能达	431,849.00	2.15
378	601975	招商南油	430,647.00	2.14
379	002611	东方精工	429,883.00	2.14
380	300684	中石科技	429,809.00	2.14
381	300872	天阳科技	426,242.00	2.12
382	300428	立中集团	425,346.00	2.12
383	002273	水晶光电	425,093.00	2.11
384	600705	中航产融	423,004.00	2.10
385	300953	震裕科技	422,237.00	2.10
386	605099	共创草坪	420,807.00	2.09
387	603056	德邦股份	420,567.00	2.09
388	301015	百洋医药	418,824.00	2.08
389	300144	宋城演艺	418,096.00	2.08
390	688561	奇安信	417,950.30	2.08
391	601058	赛轮轮胎	417,795.00	2.08
392	000969	安泰科技	414,705.00	2.06
393	688066	航天宏图	413,998.90	2.06
394	003006	百亚股份	413,638.00	2.06
395	002435	长江健康	413,001.00	2.05
396	002194	武汉凡谷	410,492.00	2.04
397	601898	中煤能源	410,035.00	2.04
398	002390	信邦制药	408,702.00	2.03
399	002558	巨人网络	408,471.00	2.03
400	603533	掌阅科技	408,280.00	2.03
401	600704	物产中大	408,235.00	2.03
402	001696	宗申动力	407,130.00	2.02
403	300316	晶盛机电	406,505.00	2.02
404	300942	易瑞生物	406,329.00	2.02
405	688318	财富趋势	406,114.00	2.02

406	688091	上海谊众	405,241.94	2.02
407	601766	中国中车	403,968.00	2.01
408	000157	中联重科	403,381.00	2.01

注：买入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。

8.4.2 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	300750	宁德时代	3,495,937.28	17.39
2	002371	北方华创	3,265,267.00	16.24
3	000725	京东方 A	2,870,833.00	14.28
4	688111	金山办公	2,594,020.31	12.90
5	601318	中国平安	2,567,551.00	12.77
6	000858	五粮液	2,431,958.00	12.10
7	300058	蓝色光标	2,313,434.00	11.51
8	601728	中国电信	2,302,109.00	11.45
9	300896	爱美客	2,238,856.00	11.14
10	002463	沪电股份	2,090,803.50	10.40
11	000568	泸州老窖	2,018,635.00	10.04
12	002594	比亚迪	1,999,552.00	9.95
13	000100	TCL 科技	1,972,186.10	9.81
14	002422	科伦药业	1,957,250.00	9.73
15	002600	领益智造	1,944,965.00	9.67
16	300763	锦浪科技	1,939,011.00	9.64
17	603613	国联股份	1,907,717.24	9.49
18	300832	新产业	1,867,615.00	9.29
19	002466	天齐锂业	1,840,298.00	9.15
20	002292	奥飞娱乐	1,831,846.00	9.11
21	300033	同花顺	1,811,363.00	9.01
22	000988	华工科技	1,803,639.00	8.97
23	688390	固德威	1,802,024.94	8.96
24	300024	机器人	1,798,110.00	8.94
25	603605	珀莱雅	1,778,897.20	8.85
26	688012	中微公司	1,773,926.97	8.82
27	000651	格力电器	1,759,107.00	8.75
28	000818	航锦科技	1,755,659.00	8.73
29	002475	立讯精密	1,739,543.31	8.65
30	600519	贵州茅台	1,727,963.00	8.59
31	601398	工商银行	1,716,401.00	8.54
32	002236	大华股份	1,713,987.00	8.52
33	601333	广深铁路	1,669,673.00	8.30
34	300059	东方财富	1,661,778.20	8.27
35	688063	派能科技	1,647,539.48	8.19

36	300860	锋尚文化	1,630,886.00	8.11
37	300130	新国都	1,627,813.00	8.10
38	300014	亿纬锂能	1,625,571.00	8.08
39	002368	太极股份	1,598,419.00	7.95
40	601816	京沪高铁	1,592,151.00	7.92
41	300762	上海瀚讯	1,561,164.00	7.76
42	601012	隆基绿能	1,533,221.39	7.63
43	003021	兆威机电	1,518,132.36	7.55
44	300229	拓尔思	1,508,336.00	7.50
45	300133	华策影视	1,501,101.00	7.47
46	688188	柏楚电子	1,478,112.63	7.35
47	601929	吉视传媒	1,466,019.00	7.29
48	688202	美迪西	1,458,690.77	7.25
49	603379	三美股份	1,452,353.00	7.22
50	002027	分众传媒	1,427,922.00	7.10
51	601138	工业富联	1,417,940.00	7.05
52	300765	新诺威	1,409,164.40	7.01
53	300394	天孚通信	1,400,309.00	6.96
54	605499	东鹏饮料	1,399,480.00	6.96
55	601989	中国重工	1,389,180.00	6.91
56	601288	农业银行	1,366,984.00	6.80
57	000063	中兴通讯	1,359,724.00	6.76
58	002352	顺丰控股	1,357,647.00	6.75
59	003816	中国广核	1,349,780.00	6.71
60	002738	中矿资源	1,342,582.00	6.68
61	600016	民生银行	1,341,369.00	6.67
62	000425	徐工机械	1,311,896.00	6.52
63	601162	天风证券	1,310,505.00	6.52
64	300476	胜宏科技	1,303,713.00	6.48
65	300170	汉得信息	1,300,317.73	6.47
66	601628	中国人寿	1,298,350.00	6.46
67	002017	东信和平	1,298,295.80	6.46
68	605117	德业股份	1,291,114.00	6.42
69	300308	中际旭创	1,280,573.00	6.37
70	688100	威胜信息	1,277,755.34	6.36
71	300502	新易盛	1,274,925.20	6.34
72	002421	达实智能	1,263,031.00	6.28
73	601997	贵阳银行	1,258,248.00	6.26
74	600331	宏达股份	1,251,461.00	6.22
75	600050	中国联通	1,239,239.00	6.16
76	601958	金铂股份	1,217,463.00	6.06
77	300115	长盈精密	1,209,813.00	6.02
78	300634	彩讯股份	1,204,903.00	5.99

79	300390	天华新能	1,200,643.10	5.97
80	600369	西南证券	1,179,599.00	5.87
81	002085	万丰奥威	1,174,531.00	5.84
82	601319	中国人保	1,173,575.00	5.84
83	601988	中国银行	1,170,738.00	5.82
84	600901	江苏金租	1,167,380.00	5.81
85	300474	景嘉微	1,164,744.00	5.79
86	002174	游族网络	1,164,330.00	5.79
87	002351	漫步者	1,161,106.00	5.77
88	000932	华菱钢铁	1,154,831.00	5.74
89	000563	陕国投 A	1,143,157.00	5.69
90	000690	宝新能源	1,133,208.50	5.64
91	600958	东方证券	1,132,152.00	5.63
92	000338	潍柴动力	1,122,930.00	5.59
93	600900	长江电力	1,119,505.00	5.57
94	002217	合力泰	1,107,200.00	5.51
95	603000	人民网	1,106,939.00	5.51
96	600246	万通发展	1,103,680.00	5.49
97	300251	光线传媒	1,089,476.00	5.42
98	002291	遥望科技	1,087,411.00	5.41
99	600871	石化油服	1,085,147.00	5.40
100	002459	晶澳科技	1,080,977.40	5.38
101	600996	贵广网络	1,079,022.00	5.37
102	600928	西安银行	1,072,700.00	5.34
103	300900	广联航空	1,072,318.00	5.33
104	000598	兴蓉环境	1,069,259.00	5.32
105	300910	瑞丰新材	1,065,169.00	5.30
106	688127	蓝特光学	1,065,009.66	5.30
107	600036	招商银行	1,064,244.00	5.29
108	002517	恺英网络	1,062,641.00	5.29
109	603993	洛阳钼业	1,056,739.00	5.26
110	002063	远光软件	1,054,477.00	5.24
111	000540	*ST 中天	1,047,738.00	5.21
112	688617	惠泰医疗	1,044,908.67	5.20
113	002867	周大生	1,040,512.75	5.18
114	003035	南网能源	1,032,893.95	5.14
115	601668	中国建筑	1,022,369.00	5.08
116	601899	紫金矿业	1,018,743.00	5.07
117	300760	迈瑞医疗	1,018,367.00	5.06
118	688639	华恒生物	1,016,743.23	5.06
119	000937	冀中能源	1,016,727.00	5.06
120	600547	山东黄金	1,013,162.00	5.04
121	002020	京新药业	1,010,913.60	5.03

122	300054	鼎龙股份	1,009,311.00	5.02
123	002460	赣锋锂业	1,007,736.00	5.01
124	688578	艾力斯	1,007,287.19	5.01
125	688981	中芯国际	987,161.85	4.91
126	300856	科思股份	984,647.00	4.90
127	603328	依顿电子	976,474.00	4.86
128	300253	卫宁健康	956,125.00	4.76
129	688330	宏力达	953,099.92	4.74
130	300751	迈为股份	951,308.20	4.73
131	600959	江苏有线	950,925.00	4.73
132	688158	优刻得	949,979.67	4.72
133	688001	华兴源创	948,210.62	4.72
134	000426	兴业银锡	947,674.00	4.71
135	300525	博思软件	941,939.00	4.68
136	300455	航天智装	941,014.00	4.68
137	002415	海康威视	937,552.00	4.66
138	688321	微芯生物	935,703.56	4.65
139	688700	东威科技	935,165.14	4.65
140	601077	渝农商行	927,955.00	4.62
141	000048	京基智农	927,222.00	4.61
142	002230	科大讯飞	927,012.00	4.61
143	300274	阳光电源	926,160.00	4.61
144	000021	深科技	921,687.00	4.58
145	688777	中控技术	917,071.23	4.56
146	688521	芯原股份	914,237.07	4.55
147	600030	中信证券	912,629.00	4.54
148	300001	特锐德	902,123.00	4.49
149	300357	我武生物	899,997.00	4.48
150	002979	雷赛智能	899,877.00	4.48
151	688586	江航装备	896,529.81	4.46
152	002276	万马股份	889,096.00	4.42
153	002065	东华软件	886,922.00	4.41
154	002252	上海莱士	886,654.00	4.41
155	688277	天智航	884,343.38	4.40
156	002409	雅克科技	882,713.00	4.39
157	002215	诺普信	882,045.00	4.39
158	601857	中国石油	880,470.00	4.38
159	000002	万科 A	871,941.00	4.34
160	300628	亿联网络	864,501.00	4.30
161	002714	牧原股份	863,581.00	4.30
162	002318	久立特材	859,175.00	4.27
163	002803	吉宏股份	856,366.00	4.26
164	688256	寒武纪	854,149.40	4.25

165	603599	广信股份	844,769.20	4.20
166	600223	福瑞达	840,486.00	4.18
167	600415	小商品城	821,059.00	4.08
168	002129	TCL 中环	819,451.50	4.08
169	002741	光华科技	809,649.00	4.03
170	603108	润达医疗	807,171.00	4.01
171	600309	万华化学	805,355.00	4.01
172	300212	易华录	802,296.00	3.99
173	300363	博腾股份	792,668.00	3.94
174	600879	航天电子	782,226.00	3.89
175	600971	恒源煤电	782,209.00	3.89
176	688499	利元亨	778,256.23	3.87
177	601231	环旭电子	776,061.00	3.86
178	003031	中瓷电子	771,683.00	3.84
179	601186	中国铁建	767,092.00	3.82
180	002088	鲁阳节能	766,745.00	3.81
181	600089	特变电工	756,709.00	3.76
182	300035	中科电气	754,165.36	3.75
183	002865	钧达股份	744,399.24	3.70
184	002847	盐津铺子	738,068.00	3.67
185	300607	拓斯达	728,984.00	3.63
186	301089	拓新药业	728,954.00	3.63
187	002049	紫光国微	728,389.00	3.62
188	002697	红旗连锁	727,581.00	3.62
189	300205	天喻信息	725,534.00	3.61
190	600276	恒瑞医药	722,822.40	3.60
191	300009	安科生物	722,639.00	3.59
192	000560	我爱我家	721,893.00	3.59
193	002832	比音勒芬	719,547.00	3.58
194	600380	健康元	717,979.00	3.57
195	688116	天奈科技	714,583.76	3.55
196	603105	芯能科技	714,532.24	3.55
197	688680	海优新材	712,058.51	3.54
198	300567	精测电子	709,493.00	3.53
199	002649	博彦科技	708,592.00	3.52
200	600845	宝信软件	707,856.00	3.52
201	601881	中国银河	707,319.24	3.52
202	600438	通威股份	706,523.00	3.51
203	600582	天地科技	703,369.00	3.50
204	000851	高鸿股份	702,006.00	3.49
205	600863	内蒙华电	700,116.00	3.48
206	002991	甘源食品	695,697.00	3.46
207	601868	中国能建	690,121.00	3.43

208	300655	晶瑞电材	688,647.00	3.43
209	002028	思源电气	687,193.00	3.42
210	002317	众生药业	682,594.00	3.39
211	002179	中航光电	681,053.80	3.39
212	002400	省广集团	679,720.00	3.38
213	000938	紫光股份	679,180.00	3.38
214	300168	万达信息	676,185.00	3.36
215	601009	南京银行	675,231.00	3.36
216	600909	华安证券	674,768.50	3.36
217	000961	中南建设	670,989.00	3.34
218	300723	一品红	666,928.50	3.32
219	000656	金科股份	662,358.00	3.29
220	301031	中熔电气	661,806.00	3.29
221	300151	昌红科技	660,065.00	3.28
222	002222	福晶科技	655,805.00	3.26
223	600895	张江高科	655,720.00	3.26
224	601106	中国一重	650,306.00	3.23
225	002034	旺能环境	648,270.00	3.22
226	600129	太极集团	647,275.00	3.22
227	300232	洲明科技	645,819.00	3.21
228	600028	中国石化	644,894.00	3.21
229	300271	华宇软件	644,537.00	3.21
230	300684	中石科技	643,468.00	3.20
231	002683	广东宏大	642,280.00	3.19
232	600572	康恩贝	637,142.00	3.17
233	300653	正海生物	636,089.00	3.16
234	300079	数码视讯	634,226.00	3.15
235	600188	兖矿能源	633,559.00	3.15
236	300451	创业慧康	633,101.00	3.15
237	600667	太极实业	632,133.00	3.14
238	300661	圣邦股份	628,007.00	3.12
239	000933	神火股份	624,624.00	3.11
240	000623	吉林敖东	623,820.00	3.10
241	688037	芯源微	622,196.61	3.09
242	688017	绿的谐波	620,170.44	3.08
243	605507	国邦医药	614,061.00	3.05
244	601555	东吴证券	611,092.00	3.04
245	300687	赛意信息	609,496.00	3.03
246	600039	四川路桥	609,437.00	3.03
247	000630	铜陵有色	608,762.00	3.03
248	000001	平安银行	607,341.00	3.02
249	300015	爱尔眼科	604,309.00	3.01
250	688711	宏微科技	602,436.01	3.00

251	603979	金诚信	601,787.00	2.99
252	603235	天新药业	600,721.00	2.99
253	002993	奥海科技	598,744.00	2.98
254	603959	百利科技	595,530.00	2.96
255	000166	申万宏源	594,700.00	2.96
256	002303	美盈森	592,685.00	2.95
257	600570	恒生电子	592,578.00	2.95
258	601600	中国铝业	587,864.00	2.92
259	688083	中望软件	587,326.84	2.92
260	002739	万达电影	584,673.00	2.91
261	600886	国投电力	583,466.00	2.90
262	600025	华能水电	581,813.00	2.89
263	601166	兴业银行	579,160.00	2.88
264	300423	昇辉科技	574,316.00	2.86
265	601939	建设银行	570,681.00	2.84
266	601888	中国中免	570,199.00	2.84
267	300470	中密控股	566,675.40	2.82
268	688005	容百科技	564,479.77	2.81
269	601577	长沙银行	563,841.00	2.80
270	300761	立华股份	562,983.60	2.80
271	600775	南京熊猫	562,714.00	2.80
272	688088	虹软科技	559,414.57	2.78
273	600329	达仁堂	551,520.00	2.74
274	002372	伟星新材	548,636.00	2.73
275	601198	东兴证券	548,281.00	2.73
276	600742	一汽富维	544,404.00	2.71
277	002156	通富微电	540,648.00	2.69
278	688208	道通科技	539,708.04	2.68
279	601088	中国神华	539,440.00	2.68
280	601688	华泰证券	539,045.00	2.68
281	000682	东方电子	538,408.00	2.68
282	000567	海德股份	537,831.60	2.67
283	300487	蓝晓科技	537,273.00	2.67
284	000895	双汇发展	533,946.00	2.66
285	002838	道恩股份	533,878.00	2.66
286	300395	菲利华	533,208.00	2.65
287	688389	普门科技	531,419.69	2.64
288	300866	安克创新	531,098.00	2.64
289	000950	重药控股	529,920.00	2.64
290	000977	浪潮信息	527,629.00	2.62
291	605589	圣泉集团	527,012.00	2.62
292	002056	横店东磁	526,950.00	2.62
293	000676	智度股份	526,181.00	2.62

294	300382	斯莱克	521,636.00	2.59
295	000878	云南铜业	520,830.00	2.59
296	000652	泰达股份	520,708.00	2.59
297	601179	中国西电	520,494.00	2.59
298	603920	世运电路	519,791.00	2.59
299	601212	白银有色	518,396.00	2.58
300	002698	博实股份	516,490.00	2.57
301	688009	中国通号	516,283.30	2.57
302	688800	瑞可达	514,009.71	2.56
303	300102	乾照光电	513,914.00	2.56
304	600562	国睿科技	512,062.00	2.55
305	605369	拱东医疗	511,676.00	2.54
306	300406	九强生物	510,694.00	2.54
307	002344	海宁皮城	507,260.99	2.52
308	600435	北方导航	505,979.00	2.52
309	002044	美年健康	504,847.00	2.51
310	300638	广和通	504,829.40	2.51
311	002446	盛路通信	504,727.00	2.51
312	688148	芳源股份	504,267.85	2.51
313	688262	国芯科技	503,179.78	2.50
314	300602	飞荣达	498,553.00	2.48
315	601168	西部矿业	498,023.00	2.48
316	601992	金隅集团	496,902.00	2.47
317	300672	国科微	496,192.00	2.47
318	000681	视觉中国	496,186.00	2.47
319	688268	华特气体	494,654.05	2.46
320	601949	中国出版	493,324.00	2.45
321	002467	二六三	491,245.00	2.44
322	001227	兰州银行	488,391.00	2.43
323	600578	京能电力	486,556.00	2.42
324	603466	风语筑	485,322.00	2.41
325	002568	百润股份	484,880.00	2.41
326	002777	久远银海	484,460.00	2.41
327	002851	麦格米特	484,042.00	2.41
328	301029	怡合达	479,385.00	2.38
329	688686	奥普特	479,142.96	2.38
330	688733	壹石通	477,967.62	2.38
331	000708	中信特钢	476,359.00	2.37
332	300203	聚光科技	476,093.00	2.37
333	601279	英利汽车	475,772.00	2.37
334	002176	江特电机	472,752.00	2.35
335	002131	利欧股份	470,960.00	2.34
336	605099	共创草坪	469,891.00	2.34

337	603826	坤彩科技	469,836.00	2.34
338	688383	新益昌	464,691.15	2.31
339	002015	协鑫能科	463,007.00	2.30
340	601169	北京银行	460,207.00	2.29
341	300080	易成新能	458,089.00	2.28
342	600131	国网信通	455,925.00	2.27
343	300666	江丰电子	452,851.00	2.25
344	300383	光环新网	451,745.00	2.25
345	300418	昆仑万维	451,136.00	2.24
346	300101	振芯科技	450,884.00	2.24
347	000733	振华科技	450,701.00	2.24
348	000423	东阿阿胶	449,165.00	2.23
349	600160	巨化股份	449,026.00	2.23
350	300428	立中集团	446,778.00	2.22
351	600273	嘉化能源	446,555.00	2.22
352	000917	电广传媒	446,115.00	2.22
353	002583	海能达	442,814.00	2.20
354	688315	诺禾致源	441,575.98	2.20
355	002142	宁波银行	441,344.00	2.20
356	000333	美的集团	440,256.00	2.19
357	300408	三环集团	439,260.00	2.18
358	001979	招商蛇口	435,705.00	2.17
359	688173	希荻微	432,813.28	2.15
360	688106	金宏气体	432,765.58	2.15
361	605168	三人行	432,123.00	2.15
362	300456	赛微电子	430,735.15	2.14
363	002938	鹏鼎控股	430,114.00	2.14
364	600705	中航产融	429,996.00	2.14
365	688019	安集科技	429,290.77	2.14
366	601975	招商南油	428,592.00	2.13
367	603060	国检集团	427,499.24	2.13
368	601658	邮储银行	427,020.00	2.12
369	002273	水晶光电	425,965.00	2.12
370	601799	星宇股份	424,277.00	2.11
371	000913	钱江摩托	423,813.00	2.11
372	300777	中简科技	422,132.00	2.10
373	300149	睿智医药	421,231.00	2.10
374	002219	新里程	418,732.00	2.08
375	300872	天阳科技	418,374.00	2.08
376	002611	东方精工	418,162.00	2.08
377	002152	广电运通	417,803.00	2.08
378	600335	国机汽车	416,574.00	2.07
379	301060	兰卫医学	416,031.00	2.07

380	000596	古井贡酒	415,622.00	2.07
381	002436	兴森科技	415,178.00	2.06
382	300316	晶盛机电	409,250.00	2.04
383	601058	赛轮轮胎	408,526.00	2.03
384	300031	宝通科技	407,521.00	2.03
385	300953	震裕科技	407,421.00	2.03
386	600704	物产中大	406,904.00	2.02
387	601898	中煤能源	405,903.00	2.02
388	300109	新开源	404,740.00	2.01
389	600674	川投能源	403,499.00	2.01
390	300027	华谊兄弟	403,317.00	2.01

注：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。

8.4.3 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	509,215,379.47
卖出股票收入（成交）总额	500,591,694.51

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	35,047.98	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,047.98	0.15

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123228	震裕转债	232	26,696.70	0.12
2	118038	金宏转债	40	4,992.02	0.02
3	118040	宏微转债	30	3,359.26	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将基于国内股指期货市场的现状，根据上期沪深 300 股指期货当月合约的基差率的高低决定股票资产的投资比例。当基差率处于历史较高水平时，股指期货贴水收敛甚至为升水状态，本基金将配置较高比例的股票资产；反之，将适当降低股票资产的比例配置，以降低股指期货贴水对投资收益产生的负面影响。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 17,158,452.41 元，占基金资产净值的比例为 74.92%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 15,758,100.00 元，占基金资产净值的比例为 68.81%，空头合约市值占股票资产的比例为 91.84%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -512,412.46 元，公允价值变动损益为 111,490.90 元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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

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

8.13.2 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。

8.13.3 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	1,915,808.67
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	130.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,915,938.67

8.13.4 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。

8.13.5 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。

8.13.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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（%）
德邦量化对冲混合 A	292	60,613.65	10,217,097.08	57.73	7,482,088.29	42.27
德邦量化对冲混合 C	4,147	1,790.64	1,111.73	0.01	7,424,652.53	99.99
合计	4,439	5,660.05	10,218,208.81	40.67	14,906,740.82	59.33

9.2 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	德邦量化对冲混合 A	212,722.54	1.2019
	德邦量化对冲混合 C	37,240.14	0.5015

人员持有本基金			
	合计	249,962.68	0.9949

9.3 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	德邦量化对冲混合 A	10~50
	德邦量化对冲混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	德邦量化对冲混合 A	-
	德邦量化对冲混合 C	-
	合计	-

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无。

9.5 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	10,217,097.08	40.67	9,999,200.00	39.80	3年
基金管理人高级管理人员	220,130.76	0.88	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,437,227.84	41.54	9,999,200.00	39.80	-

注：基金管理人于 2020 年 4 月 23 日认购德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 1000 万元，适用的认购费率为 1000 元/笔。基金管理人固有资金作为本基金的发起资金，自本基金基金合同生效之日起，认购的基金份额持有期限不少于三年。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
基金合同生效日 (2020 年 4 月 29 日) 基金份额总额	134,483,456.24	57,473,082.79
本报告期期初基金份 额总额	17,469,286.43	4,535,818.82
本报告期基金总申购 份额	13,854,150.74	286,696,182.44
减：本报告期基金总 赎回份额	13,624,251.80	283,806,237.00
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	17,699,185.37	7,425,764.26

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2023 年 2 月 18 日公告，莫秋琴女士担任公司副总经理。

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2023 年 4 月 1 日公告，吴晨先生离任公司联席总经理。

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2023 年 7 月 8 日公告，张騷先生代任公司督察长，张秀玉先生不再担任公司督察长。

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2023 年 10 月 19 日公告，徐晓红女士担任公司督察长，张騷先生不再代任公司督察长。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 3 万元整，该审计机构自基金合同生效日（2020 年 4 月 29 日）起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
长江证券	2	1,009,807,073.98	100.00	337,936.79	100.00	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择基金专用交易单元的基本选择标准：

- (1) 注册资本不低于 1 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项风险监控指标符合证监会的相关规定；
- (3) 经营行为规范，未就交易单元发生违约或侵权行为；
- (4) 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；
- (5) 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；
- (6) 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；
- (7) 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：

- (1) 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
- (2) 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，本基金新增租用中银国际证券；减少租用国盛证券、开源证券、华金证券、华创证券、东兴证券、民生证券、东吴证券、华鑫证券的交易单元。

11.7.2 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(%)
长江证券	44,708.17	100.00	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

国盛证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	德邦量化对冲策略灵活配置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关于德邦量化	中国证监会基金电子披	2023 年 2 月 13 日

	对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金增加财信证券为销售机构的公告	露网站及基金管理人网站	
8	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
9	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 C 类份额）基金产品资料概要更新	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 3 日
10	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 A 类份额）基金产品资料概要更新	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 3 日
11	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2023 年第 1 号）	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 3 日
12	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
13	德邦基金管理有限公司关于德邦量化对冲策略灵活配置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	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 22 日
14	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
15	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 30 日
16	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 31 日
17	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 4 月 1 日
18	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 4 日
19	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 10 日
20	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第 1 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 4 月 14 日
21	德邦基金管理有限公司关于德邦量化	中国证监会基金电子披	2023 年 4 月 14 日

	对冲策略灵活配置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	露网站及基金管理人网站	
22	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 24 日
23	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 26 日
24	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 5 月 17 日
25	关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 6 日
26	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 7 月 8 日
27	关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 20 日
28	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 20 日
29	关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 7 月 27 日
30	德邦基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 12 日
31	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 30 日
32	关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 9 月 16 日
33	德邦基金管理有限公司关于暂停尚智逢源（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 9 月 19 日
34	德邦基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司销售	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2023 年 9 月 27 日

	本公司旗下基金的公告	站	
35	关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 9 日
36	关于中州期货有限公司因系统改造暂停办理德邦基金管理有限公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 14 日
37	关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 14 日
38	德邦基金管理有限公司关于终止尚智逢源（北京）基金销售有限公司销售本公司旗下基金的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 18 日
39	德邦基金管理有限公司基金行业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 10 月 19 日
40	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 24 日
41	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 20 日
42	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2023 年第 2 号）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 21 日
43	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 21 日
44	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 21 日
45	关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 9 日
46	关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 22 日
47	德邦基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 27 日
48	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年底及 2024 年非港股通交易日暂停开放申购（含转换转入及定期定额投资）、赎回（含转换转出）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 28 日

	业务的公告		
49	关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20230101-20230328, 20230523-20230727, 20230804-20231018, 20231026-20231231	9,999,200.00	217,897.08	-	10,217,097.08	40.6700
	2	20230329-20230329	-	22,331,397.95	22,331,397.95	-	-
	3	20230321-20230328	-	11,154,989.85	11,154,989.85	-	-
个人	1	20231019-20231025	-	25,091,134.81	25,091,134.81	-	-
	2	20230517-20230521	-	27,765,437.58	27,765,437.58	-	-

产品特有风险

- 1、本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；
- 4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- 5、单一投资者赎回后，若本基金连续 50 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会审议，其他投资者可能面临基金合同终止的风险；
- 6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- 7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2024 年 2 月 9 日发布《德邦基金管理有限公司关于变更股权结构的公告》，具体内容详见公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、德邦量化对冲策略灵活配置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。

13.2 存放地点

上海市杨浦区荆州路 198 号万硕大厦 A 栋 25 楼。

13.3 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

2024 年 3 月 30 日