

德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式  
证券投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：德邦基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	德邦上证 G60 综指增强	
基金主代码	012415	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 29 日	
基金管理人	德邦基金管理有限公司	
基金托管人	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	15,415,244.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	德邦上证 G60 综指增强 A	德邦上证 G60 综指增强 C
下属分级基金的交易代码	012415	012416
报告期末下属分级基金的份额总额	13,556,544.56 份	1,858,699.56 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪标的指数，在严格控制与标的指数偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金为增强型指数基金，股票投资以上证 G60 创新综合指数作为标的指数。除非因为分红或基金份额持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过量化投资模型，在控制组合跟踪误差的基础上，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。
业绩比较基准	上证 G60 创新综合指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

### 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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张騷	朱巍
	联系电话	021-26010886	0571-87659806
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		4008217788	95527
传真		021-26010808	0571-88268688
注册地址		上海市虹口区东大名路 501 号	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号

	503B 单元	
办公地址	上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码	200010	310006
法定代表人	左畅	陆建强

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dbfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	德邦基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	德邦上证 G60 综指增强 A	德邦上证 G60 综指增强 C	
本期已实现收益	432,778.18	24,898.09	
本期利润	877,337.05	50,046.71	
加权平均基金份额本期利润	0.0636	0.0526	
本期加权平均净值利润率	8.80%	7.31%	
本期基金份额净值增长率	9.45%	9.32%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
	期末可供分配利润	-3,772,981.93	-522,992.48
	期末可供分配基金份额利润	-0.2783	-0.2814
	期末基金资产净值	9,833,096.01	1,342,337.09
	期末基金份额净值	0.7253	0.7222

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-27.47%	-27.78%

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

德邦上证 G60 综指增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.03%	0.82%	1.32%	0.89%	0.71%	-0.07%
过去三个月	-0.22%	0.89%	-5.17%	0.85%	4.95%	0.04%
过去六个月	9.45%	0.92%	0.11%	0.83%	9.34%	0.09%
过去一年	-14.60%	1.34%	-10.94%	1.00%	-3.66%	0.34%
自基金合同生效起至今	-27.47%	1.28%	-19.65%	1.15%	-7.82%	0.13%

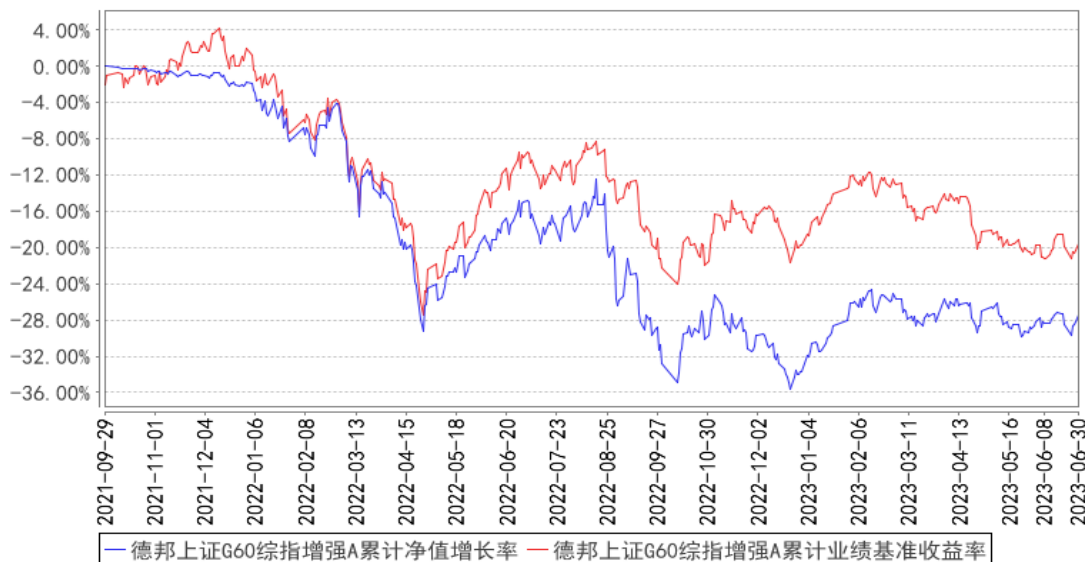
德邦上证 G60 综指增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.02%	0.82%	1.32%	0.89%	0.70%	-0.07%
过去三个月	-0.28%	0.89%	-5.17%	0.85%	4.89%	0.04%
过去六个月	9.32%	0.92%	0.11%	0.83%	9.21%	0.09%
过去一年	-14.80%	1.34%	-10.94%	1.00%	-3.86%	0.34%
自基金合同生效起至今	-27.78%	1.28%	-19.65%	1.15%	-8.13%	0.13%

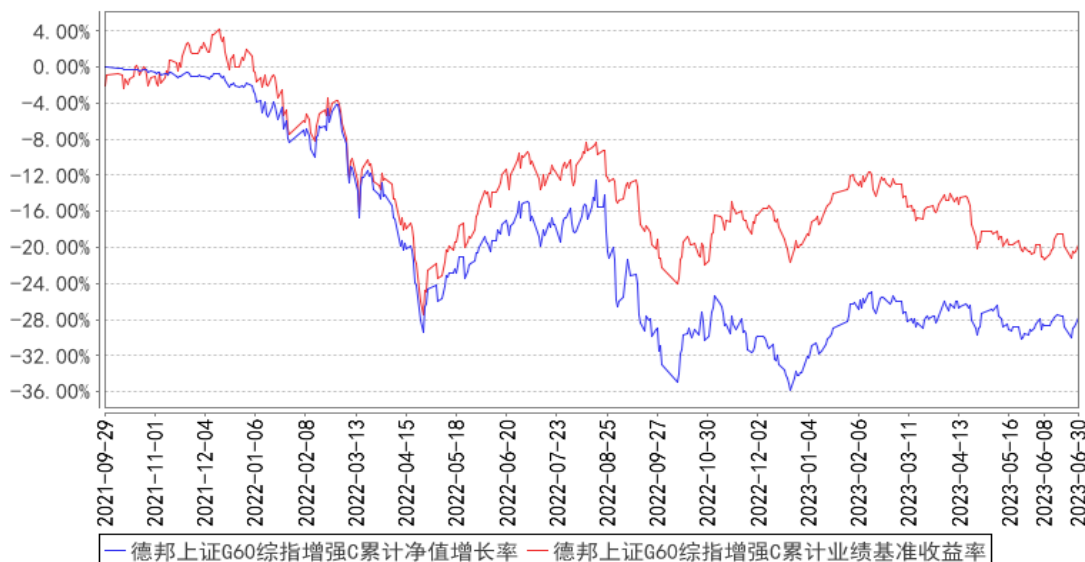
注：本基金的业绩比较基准为：上证G60创新综合指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

### 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

德邦上证G60综指增强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



德邦上证G60综指增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为2021年09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一年。本基金的建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为2021年09月29日至2023年06月30日。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2023年6月30日，本基金管理人共管理三十二只开放式基金：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦稳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、德邦惠利混合型证券投资基金、德邦锐泽86个月定期开放债券型证券投资基金、德邦科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、德邦沪港深龙头混合型证券投资基金、德邦锐裕利率债债券型证券投资基金、德邦安顺混合型证券投资基金、德邦上证G60创新综合指数增强型发起式证券投资基金、德邦价值优选混合型证券投资基金、德邦周期精选混合型发起式证券投资基金、德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金、德邦港股通成长精选混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴志鹏	本基金的基金经理	2021年10月12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，专户投资部投资经理，量化投资部研究员。现任德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦鑫星价值灵活配置混合型证

					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、德邦景颐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、德邦惠利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、德邦周期精选混合型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，且未发现其他可能导致不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

2023 年 2 季度，疫后经济修复的动能逐渐转弱，市场逐渐从年初的强预期向弱现实进行回摆，与经济总量相关较高的板块不断下跌。而价格的回落又带来更悲观的预期，甚至呈现出螺旋式下跌的态势。在这样的“寒夜”中，光模块，AI 机器人等充满“梦想”的板块成为了市场中唯一的光。而对于如何走出“寒夜”，政策刺激好像成了市场愿意相信的唯一选项，各种关于大政策的“小作文”层出不穷。但是，经济的修复已经到了“非刺激不可吗？”。

投资管理上，管理人判断，中特估将会成为本轮行情的主线之一，央国企在国资委考核变更下的盈利能力逐渐改善，更加关注股东回报，或许可以打破大部分央国企长期被低估的现状；顺周期资产随着 PPI 见底也即将迎来一轮极度悲观估值的修复，本基金的选股也将重点围绕上述方向进行展开。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末德邦上证 G60 综指增强 A 基金份额净值为 0.7253 元，基金份额净值增长率为 9.45%，同期业绩比较基准收益率为 0.11%；德邦上证 G60 综指增强 C 基金份额净值为 0.7222 元，基金份额净值增长率为 9.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.11%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，从 PPI 的周期看，短周期目前大概率已经处于底部区域了，下行的动能正在逐步减弱，最差的时候可能就在 Q2；同时，从历史规律上看，CRB 工业现货的短周期大约领先 PPI 的短周期一个季度左右的时间，CRB 工业现货的短周期已在 Q1 见底，所以我们对下半年 PPI 可以更加乐观一些。对于顺周期的资产来说，目前的估值已经处于历史上极低的水平，这样的估值水平中蕴含了对这些资产未来极度悲观的预期，随着 PPI 最差的时候过去，这些资产极度悲观的预期可能也会面临着修复。估值或者情绪就像是钟摆，总是在极度悲观和极度乐观之间来回摇摆，却从来不在合理的位置停下。

从估值的角度来看，当前沪深 300 指数市盈率 11 倍左右，处于历史上较低水平，极具性价比。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

在每个估值日，本基金管理人按照最新的会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。经托管人复核无误后，由基金管理人依据基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——德邦基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对德邦基金管理有限公司编制和披露的德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组

合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	844,221.16	660,536.86
结算备付金		47,613.31	65,812.57
存出保证金		3,384.10	10,101.95
交易性金融资产	6.4.7.2	10,390,660.20	8,972,182.58
其中：股票投资		10,390,660.20	8,893,176.00
基金投资		-	-
债券投资		-	79,006.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	60,245.39
应收股利		-	-
应收申购款		182,271.36	974.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		11,468,150.13	9,769,853.43
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		74,368.06	-
应付赎回款		160,997.68	20,224.76
应付管理人报酬		8,937.43	8,360.61
应付托管费		1,608.74	1,504.88
应付销售服务费		230.59	104.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.27
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	46,574.53	61,809.78
负债合计		292,717.03	92,004.54
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	15,415,244.12	14,606,751.49
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-4,239,811.02	-4,928,902.60
净资产合计		11,175,433.10	9,677,848.89
负债和净资产总计		11,468,150.13	9,769,853.43

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，德邦上证 G60 综指增强 A 基金份额净值 0.7253 元，基金份额总额 13,556,544.56 份；德邦上证 G60 综指增强 C 基金份额净值 0.7222 元，基金份额总额 1,858,699.56 份。德邦上证 G60 综指增强份额总额合计 15,415,244.12 份。

## 6.2 利润表

会计主体：德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,005,358.93	-1,873,387.85
1. 利息收入		1,769.35	5,130.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,769.35	5,130.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		533,657.91	-2,450,016.39
其中：股票投资收益	6.4.7.14	400,945.40	-2,604,700.37
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	26,870.44	11,275.96
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	105,842.07	143,408.02
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	469,707.49	571,122.93
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	224.18	374.64
<b>减：二、营业总支出</b>		77,975.17	89,147.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	52,756.05	62,215.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,496.09	11,198.90
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	846.61	856.38
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.03	0.04
8. 其他费用	6.4.7.23	14,876.39	14,876.39
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		927,383.76	-1,962,535.35
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		927,383.76	-1,962,535.35
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		927,383.76	-1,962,535.35

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	14,606,751.49	-	-4,928,902.60	9,677,848.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	14,606,751.49	-	-4,928,902.60	9,677,848.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	808,492.63	-	689,091.58	1,497,584.21
(一)、综合收益总额	-	-	927,383.76	927,383.76
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	808,492.63	-	-238,292.18	570,200.45
其中：1. 基金申购款	5,431,486.82	-	-1,529,824.12	3,901,662.70
2. 基金赎回款	-4,622,994.19	-	1,291,531.94	-3,331,462.25
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	15,415,244.12	-	-4,239,811.02	11,175,433.10
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	14,742,019.00	-	-251,012.37	14,491,006.63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-



其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	14,742,019.00	-	-251,012.37	14,491,006.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-170,797.30	-	-1,945,877.91	-2,116,675.21
(一)、综合收益总额	-	-	-1,962,535.35	-1,962,535.35
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-170,797.30	-	16,657.44	-154,139.86
其中：1. 基金申购款	1,570,351.07	-	-200,734.79	1,369,616.28
2. 基金赎回款	-1,741,148.37	-	217,392.23	-1,523,756.14
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	14,571,221.70	-	-2,196,890.28	12,374,331.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张騫

洪双龙

洪双龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]1433 号文《关于准予德邦上证 G60 创新综合指数增强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

公司于 2021 年 6 月 28 日至 2021 年 9 月 27 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具安永华明（2021）验字第 60982868\_B04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 9 月 29 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 14,810,171.44 元，在募集期间产生的利息为人民币 2,114.86 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 14,812,286.30 元，折合 14,812,286.30 份基金份额。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，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的业绩比较基准为：上证 G60 创新综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 6.4.6.2 增值税

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

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息

所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	844,221.16
等于：本金	844,172.74
加：应计利息	48.42
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	844,221.16

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		10,319,982.93	-	10,390,660.20	70,677.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		10,319,982.93	-	10,390,660.20	70,677.27

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末不存在按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

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

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

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

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

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

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

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

**6.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	31,698.14
其中：交易所市场	31,698.14
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	14,876.39
合计	46,574.53

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

## 德邦上证 G60 综指增强 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,870,782.05	13,870,782.05
本期申购	1,013,689.51	1,013,689.51
本期赎回（以“-”号填列）	-1,327,927.00	-1,327,927.00
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	13,556,544.56	13,556,544.56

## 德邦上证 G60 综指增强 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	735,969.44	735,969.44
本期申购	4,417,797.31	4,417,797.31
本期赎回（以“-”号填列）	-3,295,067.19	-3,295,067.19
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	1,858,699.56	1,858,699.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

德邦上证 G60 综指增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,290,052.46	-389,051.42	-4,679,103.88
本期利润	432,778.18	444,558.87	877,337.05
本期基金份额交易产生的变动数	84,292.35	-5,974.07	78,318.28
其中：基金申购款	-295,323.36	17,704.63	-277,618.73
基金赎回款	379,615.71	-23,678.70	355,937.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,772,981.93	49,533.38	-3,723,448.55

德邦上证 G60 综指增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-229,159.54	-20,639.18	-249,798.72
本期利润	24,898.09	25,148.62	50,046.71
本期基金份额交易产生的变动数	-318,731.03	2,120.57	-316,610.46
其中：基金申购款	-1,249,340.74	-2,864.65	-1,252,205.39
基金赎回款	930,609.71	4,985.22	935,594.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-522,992.48	6,630.01	-516,362.47

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,287.09
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	432.80
其他	49.46
合计	1,769.35

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	400,945.40
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	400,945.40

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	40,430,089.30
减：卖出股票成本总额	39,922,794.14
减：交易费用	106,349.76
买卖股票差价收入	400,945.40

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	6.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	26,863.47
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	26,870.44

##### 6.4.7.15.2 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6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	236,651.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	209,705.56
减：应计利息总额	68.32
减：交易费用	13.65
买卖债券差价收入	26,863.47

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	105,842.07
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	105,842.07

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	469,707.49
股票投资	469,707.49
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	469,707.49

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	224.18
合计	224.18

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,876.39

信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	14,876.39

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
德邦基金管理有限公司（“德邦基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）	基金托管人
德邦证券股份有限公司（“德邦证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 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	81,380,660.15	100.00	116,710,670.13	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
德邦证券	341,411.00	100.00	60,810.00	100.00

### 6.4.10.1.3 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。

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
德邦证券	59,513.23	100.00	31,698.14	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 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	85,351.11	100.00	53,815.05	100.00

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	52,756.05	62,215.79
其中：支付销售机构的客户维护费	18,090.51	19,300.08

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,496.09	11,198.90

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.18%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.18\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
	德邦上证 G60 综指增强 A	德邦上证 G60 综指增强 C
基金合同生效日（2021年9月29日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	73.7651%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日

	德邦上证 G60 综指增强 A	德邦上证 G60 综指增强 C
基金合同生效日（2021 年 9 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	68.6300%	-

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

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行	844,221.16	1,287.09	971,112.25	2,096.73

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未发生其它关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总	备注
------	------	------	------	------	------	-------	-------	--------	-------	----

				单价		价			额	
600530	交大昂立	2023年5月4日	重大事项停牌	2.49	2023年7月5日	2.37	12,100	39,828.00	30,129.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理，对公司建立风险管理体系和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，协助董事会进行风险管理，风险管理委员会负责起草公司风险管理战略，审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。经理层负责落实董事会拟定的风险管理政策，并对风险控制的有效执行承担责任。经理层下设风险控制委员会，协助经理层进行风险控制，风险控制委员会负责组织风险管理体系的建设，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内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资。（2022 年 12 月 31 日，0.82%）

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	79,006.58
未评级	-	-
合计	-	79,006.58

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券均在证券交易所交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	844,221.16	-	-	-	-	-	844,221.16

结算备付金	47,613.31	-	-	-	-	-	47,613.31
存出保证金	3,384.10	-	-	-	-	-	3,384.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-10,390,660.20	10,390,660.20
应收申购款	-	-	-	-	-	182,271.36	182,271.36
资产总计	895,218.57	-	-	-	-	-10,572,931.56	11,468,150.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	160,997.68	160,997.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,937.43	8,937.43
应付托管费	-	-	-	-	-	1,608.74	1,608.74
应付清算款	-	-	-	-	-	74,368.06	74,368.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-	230.59	230.59
其他负债	-	-	-	-	-	46,574.53	46,574.53
负债总计	-	-	-	-	-	292,717.03	292,717.03
利率敏感度缺口	895,218.57	-	-	-	-	-10,280,214.53	11,175,433.10
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	660,536.86	-	-	-	-	-	660,536.86
结算备付金	65,812.57	-	-	-	-	-	65,812.57
存出保证金	10,101.95	-	-	-	-	-	10,101.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-79,006.58	8,893,176.00	8,972,182.58
应收申购款	-	-	-	-	-	974.08	974.08
应收清算款	-	-	-	-	-	60,245.39	60,245.39
资产总计	736,451.38	-	-	-	-79,006.58	8,954,395.47	9,769,853.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,224.76	20,224.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,360.61	8,360.61
应付托管费	-	-	-	-	-	1,504.88	1,504.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-	104.24	104.24
应交税费	-	-	-	-	-	0.27	0.27
其他负债	-	-	-	-	-	61,809.78	61,809.78
负债总计	-	-	-	-	-	92,004.54	92,004.54
利率敏感度缺口	736,451.38	-	-	-	-79,006.58	8,862,390.93	9,677,848.89

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日，0.8164%），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日，同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市和交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	10,390,660.20	92.98	8,893,176.00	91.89
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	79,006.58	0.82
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	10,390,660.20	92.98	8,972,182.58	92.71

注：本基金投资于股票组合的比例为基金资产的 80%–95%，其中投资于上证 G60 创新综合指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈现线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；	
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	沪深 300 上升 1%		78,785.44
沪深 300 下降 1%		-78,785.44	-79,460.90

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。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	10,360,531.20	8,893,176.00
第二层次	30,129.00	79,006.58
第三层次	-	-
合计	10,390,660.20	8,972,182.58

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	10,390,660.20	90.60
	其中：股票	10,390,660.20	90.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	891,834.47	7.78
8	其他各项资产	185,655.46	1.62
9	合计	11,468,150.13	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,945,221.00	62.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	293,093.00	2.62
E	建筑业	57,216.00	0.51
F	批发和零售业	212,940.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	416,848.00	3.73

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	950,880.20	8.51
J	金融业	563,694.00	5.04
K	房地产业	111,027.00	0.99
L	租赁和商务服务业	340,780.00	3.05
M	科学研究和技术服务业	231,480.00	2.07
N	水利、环境和公共设施管理业	133,742.00	1.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	103,610.00	0.93
S	综合	-	-
	合计	10,360,531.20	92.71

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,129.00	0.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	30,129.00	0.27

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资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	600761	安徽合力	15,900	316,887.00	2.84
2	600012	皖通高速	29,800	312,304.00	2.79
3	603298	杭叉集团	13,100	308,505.00	2.76
4	688106	金宏气体	9,400	255,680.00	2.29
5	688288	鸿泉物联	9,300	236,406.00	2.12
6	603799	华友钴业	5,100	234,141.00	2.10
7	600415	小商品城	25,000	213,250.00	1.91
8	688777	中控技术	3,190	200,268.20	1.79
9	600570	恒生电子	4,400	194,876.00	1.74
10	600585	海螺水泥	8,200	194,668.00	1.74
11	603689	皖天然气	21,800	191,186.00	1.71
12	600986	浙文互联	28,600	183,040.00	1.64
13	603551	奥普家居	14,100	182,313.00	1.63
14	603611	诺力股份	6,800	179,112.00	1.60
15	603225	新凤鸣	15,900	175,695.00	1.57
16	603901	永创智能	11,000	160,160.00	1.43
17	601233	桐昆股份	12,000	159,000.00	1.42
18	600418	江淮汽车	12,300	154,857.00	1.39
19	688127	蓝特光学	8,000	141,040.00	1.26
20	603323	苏农银行	32,500	136,825.00	1.22
21	605358	立昂微	3,600	132,228.00	1.18
22	603017	中衡设计	12,000	130,680.00	1.17
23	600814	杭州解百	15,000	128,250.00	1.15
24	603300	华铁应急	23,400	127,530.00	1.14
25	600668	尖峰集团	11,000	126,720.00	1.13
26	603338	浙江鼎力	2,200	123,222.00	1.10
27	603035	常熟汽饰	6,300	122,409.00	1.10
28	601108	财通证券	16,100	116,564.00	1.04
29	603602	纵横通信	9,400	115,526.00	1.03
30	688093	世华科技	5,600	112,336.00	1.01



31	688266	泽璟制药	2,400	111,720.00	1.00
32	601512	中新集团	11,900	111,027.00	0.99
33	600571	信雅达	12,100	110,594.00	0.99
34	688030	山石网科	5,100	109,293.00	0.98
35	603823	百合花	8,580	106,392.00	0.95
36	603839	安正时尚	14,100	106,032.00	0.95
37	601555	东吴证券	15,100	104,794.00	0.94
38	600926	杭州银行	8,900	104,575.00	0.94
39	600794	保税科技	29,700	104,544.00	0.94
40	603699	纽威股份	7,000	104,160.00	0.93
41	688329	艾隆科技	3,200	103,680.00	0.93
42	600576	祥源文旅	13,000	103,610.00	0.93
43	688607	康众医疗	5,400	103,248.00	0.92
44	600023	浙能电力	20,100	101,907.00	0.91
45	601128	常熟银行	14,800	100,936.00	0.90
46	603357	设计总院	9,600	100,800.00	0.90
47	605158	华达新材	13,200	100,320.00	0.90
48	603890	春秋电子	11,700	100,152.00	0.90
49	601388	怡球资源	34,200	98,496.00	0.88
50	688586	江航装备	7,060	98,204.60	0.88
51	603558	健盛集团	11,800	97,468.00	0.87
52	688027	国盾量子	600	94,992.00	0.85
53	600176	中国巨石	6,700	94,872.00	0.85
54	688286	敏芯股份	1,500	94,470.00	0.85
55	688819	天能股份	2,500	92,100.00	0.82
56	601700	风范股份	17,100	90,801.00	0.81
57	603687	大胜达	10,600	90,312.00	0.81
58	603709	中源家居	4,800	87,072.00	0.78
59	603031	安孚科技	1,800	84,690.00	0.76
60	603966	法兰泰克	6,500	82,095.00	0.73
61	600126	杭钢股份	18,900	82,026.00	0.73
62	688656	浩欧博	2,200	80,652.00	0.72
63	688701	卓锦股份	8,900	79,833.00	0.71
64	688379	华光新材	3,900	79,209.00	0.71
65	603011	合锻智能	9,400	74,260.00	0.66
66	603897	长城科技	3,700	74,222.00	0.66
67	603150	万朗磁塑	2,800	73,808.00	0.66
68	603701	德宏股份	5,200	73,788.00	0.66
69	605268	王力安防	7,200	73,656.00	0.66
70	603527	众源新材	6,000	73,320.00	0.66
71	603618	杭电股份	11,000	71,060.00	0.64
72	600460	士兰微	2,300	69,621.00	0.62
73	688077	大地熊	2,300	69,483.00	0.62

74	603816	顾家家居	1,800	68,670.00	0.61
75	603238	诺邦股份	5,400	68,094.00	0.61
76	605338	巴比食品	2,600	65,650.00	0.59
77	603332	苏州龙杰	5,900	64,487.00	0.58
78	688685	迈信林	3,015	63,797.40	0.57
79	603980	吉华集团	14,500	61,915.00	0.55
80	600987	航民股份	7,400	60,902.00	0.54
81	688182	灿勤科技	2,400	60,552.00	0.54
82	688350	富淼科技	3,500	59,465.00	0.53
83	603828	柯利达	19,200	57,216.00	0.51
84	603806	福斯特	1,500	55,785.00	0.50
85	603486	科沃斯	700	54,439.00	0.49
86	600796	钱江生化	10,300	53,972.00	0.48
87	688679	通源环境	3,700	53,909.00	0.48
88	601606	长城军工	3,700	50,579.00	0.45
89	600200	江苏吴中	6,500	46,865.00	0.42
90	603380	易德龙	1,900	42,978.00	0.38
91	600633	浙数文化	2,300	37,283.00	0.33

### 7.3.2 期末积极投资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	600530	交大昂立	12,100	30,129.00	0.27

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	1,330,010.00	13.74
2	603258	电魂网络	1,307,319.00	13.51
3	603799	华友钴业	1,136,459.00	11.74
4	688365	光云科技	1,053,319.73	10.88
5	688390	固德威	1,020,380.14	10.54
6	688027	国盾量子	741,973.46	7.67
7	600761	安徽合力	696,594.00	7.20
8	600633	浙数文化	656,493.00	6.78
9	600986	浙文互联	629,215.00	6.50
10	603298	杭叉集团	619,308.00	6.40
11	688777	中控技术	601,340.04	6.21
12	600926	杭州银行	594,223.00	6.14
13	600012	皖通高速	582,832.00	6.02
14	688408	中信博	565,811.69	5.85
15	603338	浙江鼎力	564,606.00	5.83

16	688288	鸿泉物联	555,101.00	5.74
17	600570	恒生电子	542,914.00	5.61
18	603816	顾家家居	535,639.00	5.53
19	688106	金宏气体	517,827.04	5.35
20	600415	小商品城	474,092.00	4.90
21	601801	皖新传媒	436,779.00	4.51
22	603357	设计总院	414,267.80	4.28
23	603551	奥普家居	381,915.00	3.95
24	688017	绿的谐波	377,843.96	3.90
25	603596	伯特利	377,496.00	3.90
26	603527	众源新材	361,038.00	3.73
27	601921	浙版传媒	351,608.00	3.63
28	603806	福斯特	349,924.00	3.62
29	600763	通策医疗	334,921.00	3.46
30	600576	祥源文旅	330,062.00	3.41
31	688127	蓝特光学	314,561.90	3.25
32	688088	虹软科技	300,678.95	3.11
33	603212	赛伍技术	298,646.00	3.09
34	603890	春秋电子	296,934.00	3.07
35	605268	王力安防	285,815.00	2.95
36	603801	志邦家居	281,953.60	2.91
37	600176	中国巨石	278,817.00	2.88
38	600571	信雅达	274,337.00	2.83
39	688023	安恒信息	273,175.00	2.82
40	605358	立昂微	272,311.00	2.81
41	600023	浙能电力	262,897.00	2.72
42	603171	税友股份	257,636.00	2.66
43	600166	福田汽车	255,344.00	2.64
44	603011	合锻智能	245,177.00	2.53
45	600814	杭州解百	244,492.00	2.53
46	688819	天能股份	242,637.58	2.51
47	688030	山石网科	236,604.95	2.44
48	688536	思瑞浦	235,959.12	2.44
49	601800	中国交建	231,000.00	2.39
50	600596	新安股份	229,281.00	2.37
51	603699	纽威股份	225,805.00	2.33
52	688077	大地熊	223,599.29	2.31
53	688330	宏力达	222,376.67	2.30
54	600776	东方通信	220,237.00	2.28
55	688588	凌志软件	219,159.02	2.26
56	601512	中新集团	217,898.00	2.25
57	603005	晶方科技	215,809.00	2.23
58	603558	健盛集团	214,584.00	2.22

59	603380	易德龙	212,178.00	2.19
60	600551	时代出版	209,021.00	2.16
61	688789	宏华数科	207,921.00	2.15
62	605167	利柏特	200,852.00	2.08
63	605136	丽人丽妆	198,923.00	2.06
64	688379	华光新材	198,246.90	2.05
65	600273	嘉化能源	197,675.00	2.04
66	603600	永艺股份	194,583.00	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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688390	固德威	1,525,402.14	15.76
2	603258	电魂网络	1,369,677.00	14.15
3	603799	华友钴业	1,203,428.00	12.43
4	688365	光云科技	1,183,593.49	12.23
5	600585	海螺水泥	1,017,010.00	10.51
6	600761	安徽合力	895,856.00	9.26
7	600633	浙数文化	893,223.00	9.23
8	688408	中信博	809,749.56	8.37
9	603298	杭叉集团	794,002.00	8.20
10	600570	恒生电子	774,677.00	8.00
11	688027	国盾量子	663,640.47	6.86
12	600986	浙文互联	662,204.00	6.84
13	688023	安恒信息	656,198.00	6.78
14	688777	中控技术	649,813.39	6.71
15	601801	皖新传媒	648,165.00	6.70
16	600763	通策医疗	625,306.00	6.46
17	600926	杭州银行	552,732.00	5.71
18	688017	绿的谐波	537,664.63	5.56
19	688088	虹软科技	534,072.16	5.52
20	603806	福斯特	526,248.00	5.44
21	600012	皖通高速	509,763.00	5.27
22	688536	思瑞浦	485,544.00	5.02
23	688106	金宏气体	442,062.53	4.57
24	603338	浙江鼎力	438,855.00	4.53
25	603816	顾家家居	435,479.00	4.50
26	603171	税友股份	419,638.00	4.34
27	601921	浙版传媒	388,423.00	4.01
28	603596	伯特利	361,420.97	3.73
29	603890	春秋电子	356,627.00	3.68
30	688288	鸿泉物联	344,708.79	3.56

31	688077	大地熊	340,178.76	3.52
32	600487	亨通光电	335,905.00	3.47
33	603527	众源新材	335,807.00	3.47
34	600415	小商品城	330,483.00	3.41
35	603357	设计总院	303,741.00	3.14
36	688030	山石网科	293,348.44	3.03
37	603212	赛伍技术	290,317.00	3.00
38	688819	天能股份	283,279.07	2.93
39	600596	新安股份	276,152.60	2.85
40	688001	华兴源创	275,468.16	2.85
41	603801	志邦家居	274,320.00	2.83
42	688186	广大特材	265,023.36	2.74
43	600418	江淮汽车	262,198.00	2.71
44	600166	福田汽车	253,344.00	2.62
45	605358	立昂微	250,827.00	2.59
46	600551	时代出版	241,519.00	2.50
47	688588	凌志软件	237,119.25	2.45
48	603005	晶方科技	232,509.00	2.40
49	600776	东方通信	232,366.00	2.40
50	603225	新凤鸣	229,927.00	2.38
51	601233	桐昆股份	228,051.00	2.36
52	603558	健盛集团	223,617.00	2.31
53	600576	祥源文旅	217,438.00	2.25
54	603551	奥普家居	215,770.00	2.23
55	605167	利柏特	214,107.00	2.21
56	603600	永艺股份	214,081.00	2.21
57	688330	宏力达	212,101.40	2.19
58	601800	中国交建	211,600.00	2.19
59	603236	移远通信	205,931.00	2.13
60	603661	恒林股份	202,601.00	2.09
61	603300	华铁应急	201,847.00	2.09
62	605268	王力安防	200,874.00	2.08
63	603277	银都股份	193,692.00	2.00

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	40,950,570.85
卖出股票收入（成交）总额	40,430,089.30

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。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,384.10
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	182,271.36
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	185,655.46

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600530	交大昂立	30,129.00	0.27	重大事项停牌

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
德邦上证 G60 综指增强 A	594	22,822.47	10,000,000.00	73.77	3,556,544.56	26.23
德邦上证 G60 综指增强 C	725	2,563.72	-	-	1,858,699.56	100.00
合计	1,319	11,687.07	10,000,000.00	64.87	5,415,244.12	35.13

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理	德邦上证 G60 综指增强 A	-	-

人所有从业人员持有本基金	德邦上证 G60 综指增强 C	391.50	0.0211
	合计	391.50	0.0025

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	德邦上证 G60 综指增强 A	0
	德邦上证 G60 综指增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	德邦上证 G60 综指增强 A	0
	德邦上证 G60 综指增强 C	0
	合计	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	64.87	10,000,000.00	64.87	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	64.87	10,000,000.00	64.87	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	德邦上证 G60 综指增强 A	德邦上证 G60 综指增强 C
基金合同生效日 (2021 年 9 月 29 日) 基金份额总额	13,943,846.38	868,439.92
本报告期期初基金份额总额	13,870,782.05	735,969.44
本报告期基金总申购份额	1,013,689.51	4,417,797.31



减：本报告期基金总赎回份额	1,327,927.00	3,295,067.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,556,544.56	1,858,699.56

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

基金托管人于 2023 年 5 月 17 日发布公告，自 2023 年 5 月 10 日起丁文忠先生不再担任基金托管部门总经理；自 2023 年 5 月 10 日起聘任赵刚先生为基金托管部门总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
德邦证券	2	81,380,660.15	100.00	59,513.23	100.00	-

注：1、公司选择基金专用交易席位的基本选择标准：

- （一）注册资本不低于 1 亿元人民币；
- （二）财务状况良好，各项风险监控指标符合证监会的相关规定；
- （三）经营行为规范，未就交易单元发生违约或侵权行为；
- （四）内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足投资组合资产运作高度保密的要求；
- （五）具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理各投资组合进行证券交易的需要；
- （六）研究实力较强，能根据需求提供质量较高的研究报告，以及相应的信息咨询服务；
- （七）收取的佣金费率合理。

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

- （一）研究部按照上述选择标准对证券公司进行初步筛选，经投资总监批准后提请总经理审批；
- （二）交易部办理相关交易单元，信息技术部、基金运营部和监察稽核部等相关部门配合完成交易单元租用的技术准备、参数调整及合同签订并及时通知各投资组合的托管机构等事宜。

2、本报告期内，本基金无新增或减少租用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
德邦证券	341,411.00	100.00	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加工商银行个人电子银行费率优惠活动及 2023 倾心回馈基金定投优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 3 日

2	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 9 日
3	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 18 日
4	德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 19 日
5	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 3 日
6	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 6 日
7	德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 18 日
8	德邦基金管理有限公司关于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
9	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
10	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
11	德邦上证 G60 创新综合指数增强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
12	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
13	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
14	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
15	德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第一季度报告	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 20 日
16	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2023 年 4 月 24 日

	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	站	
17	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
18	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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101 - 20230630	10,000,000 0.00	0.00	0.00	10,000,000.00	64.87 00
产品特有风险							
<p>1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>4、单一机构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；</p> <p>5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续 60 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 万情形的，本基金将按照基金合同的约定，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会，其他投资者可能面临基金转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等的风险；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内按照规定披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-821-7788

德邦基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日