

# 德邦中证 800 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 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

报告送出日期：2026 年 4 月 21 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2026 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	德邦中证 800 指数增强
基金主代码	025513
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 11 月 11 日
报告期末基金份额总额	622,162,459.76 份
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，股票投资以中证 800 指数作为标的指数，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。本基金将通过量化投资模型，对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，综合分析比较不同金融资产的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合，在控制组合跟踪误差的基础上，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金可投资于

	港股通标的股票，需面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	德邦中证 800 指数增强 A	德邦中证 800 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	025513	025514
报告期末下属分级基金的份额总额	446,469,106.86 份	175,693,352.90 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日）	
	德邦中证 800 指数增强 A	德邦中证 800 指数增强 C
1. 本期已实现收益	10,152,481.49	6,541,463.90
2. 本期利润	-12,175,549.32	-2,789,679.54
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0195	-0.0088
4. 期末基金资产净值	434,777,241.27	170,763,179.55
5. 期末基金份额净值	0.9738	0.9719

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、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

德邦中证 800 指数增强 A

阶段	净值增长率①	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	-3.79%	0.95%	-2.15%	1.06%	-1.64%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-2.62%	0.75%	-2.68%	0.98%	0.06%	-0.23%

德邦中证 800 指数增强 C

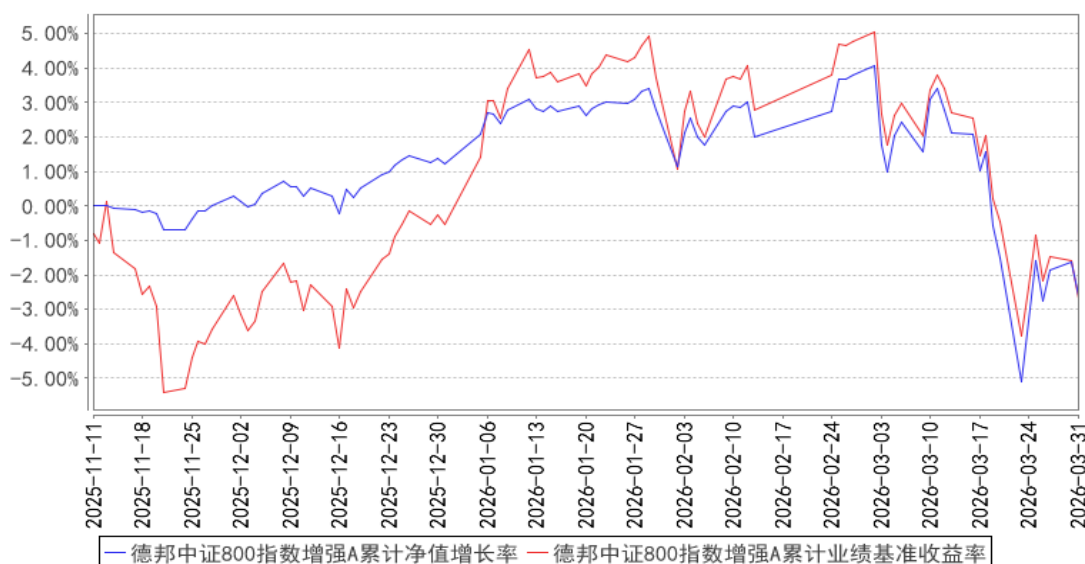
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-3.91%	0.95%	-2.15%	1.06%	-1.76%	-0.11%
自基金合同 生效起至今	-2.81%	0.75%	-2.68%	0.98%	-0.13%	-0.23%

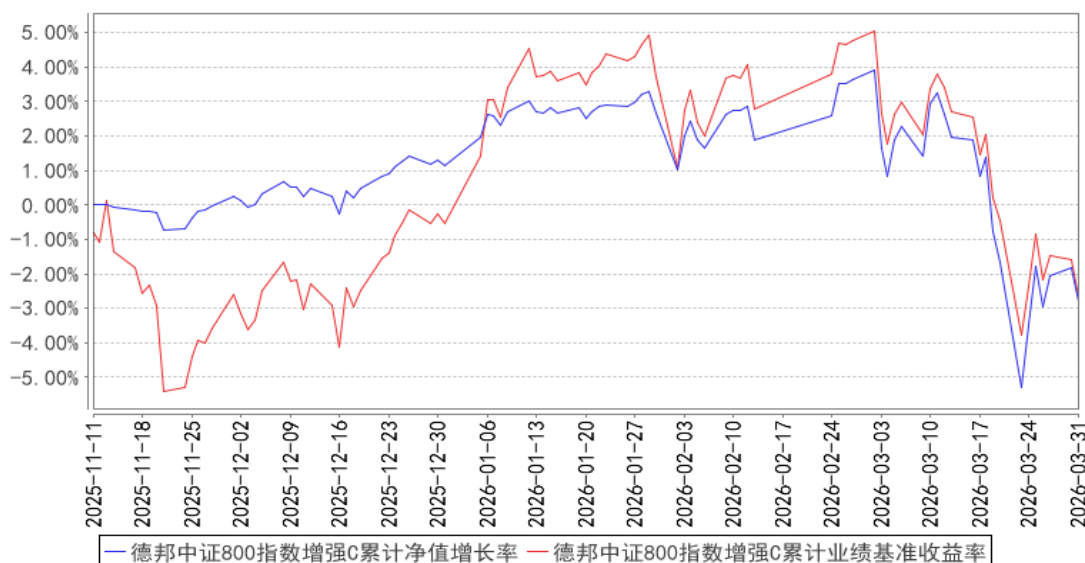
注：本基金业绩比较基准：中证 800 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%

### 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

德邦中证800指数增强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



德邦中证800指数增强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 2025 年 11 月 11 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。自合同生效日 2025 年 11 月 11 日至 2026 年 03 月 31 日本基金运作未满 6 个月，仍处于建仓期。图示日期为 2025 年 11 月 11 日至 2026 年 03 月 31 日。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2025 年 11 月 11 日	-	14 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。

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，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。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，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，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

#### 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。基金管理人未发现异常交易行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

市场自 24 年 9 月下旬推出一揽子政策后开启反弹，此事件对 A 股市场带来长期影响，并延续

至今。继 25 年全年上涨后，26 年开年市场情绪高昂，指数快速上涨，但从 3 月底开始美伊军事冲突给全球市场带来强烈波动，A 股跌至 3800 点附近。我们认为局部地缘战争的影响不会造成全球经济的颠覆性变化。随着时间推移，市场对战争影响的反应也将逐渐钝化。国内经济稳步复苏的预期较高，我们应该更关心市场自身的趋势，对其我们长期看好。

在投资管理上，本基金于 25 年 4 季度成立，26 年 1 季度部分时间仍在建仓期内。我们根据逢低建仓，安全垫建仓等原则，逐步增加仓位。同时谨慎监控各项风险暴露，控制个股风险，整体波动较小。3 月开始我们建仓完成，基本按照指数增强方式运行。本基金使用的股票组合（不考虑仓位）紧跟中证 800 指数基准，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，本基金均处于建仓期，整体波动控制良好，建仓期内绝对收益表现良好。

地缘冲突带来短期强烈冲击，但我们认为影响将逐渐钝化。中国经济在政策支持与内生创新驱动下，市场情绪较为乐观，政策层面延续“适度宽松的货币政策”与“积极的财政政策”，着力扩大内需、稳定就业、化解地方债务风险。A 股市场在政策支持下有望迎来盈利上行周期。总体而言，中国经济将在政策护航与创新驱动下展现韧性，为市场走向慢牛带来良好预期。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末德邦中证 800 指数增强 A 基金份额净值为 0.9738 元，基金份额净值增长率为 -3.79%，同期业绩比较基准收益率为 -2.15%；德邦中证 800 指数增强 C 基金份额净值为 0.9719 元，基金份额净值增长率为 -3.91%，同期业绩比较基准收益率为 -2.15%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	552,276,344.45	91.04
	其中：股票	552,276,344.45	91.04
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	53,463,898.08	8.81
8	其他资产	880,607.52	0.15
9	合计	606,620,850.05	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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	4,313,278.00	0.71
B	采矿业	39,360,668.00	6.50
C	制造业	257,367,345.25	42.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,796,353.00	0.96
E	建筑业	3,850,420.00	0.64
F	批发和零售业	3,882,350.90	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	12,604,972.36	2.08
H	住宿和餐饮业	91,358.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,600,030.00	5.22
J	金融业	82,704,673.00	13.66
K	房地产业	745,127.00	0.12
L	租赁和商务服务业	9,029,656.00	1.49
M	科学研究和技术服务业	662,142.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	1,470,976.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	609,034.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	239,624.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	454,328,007.51	75.03

### 5.2.2 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	1,578,653.00	0.26
B	采矿业	1,515,480.34	0.25
C	制造业	63,572,167.63	10.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,968,615.00	0.49
E	建筑业	223,001.00	0.04
F	批发和零售业	3,922,029.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	2,775,280.66	0.46

H	住宿和餐饮业	257,222.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,750,779.77	1.94
J	金融业	1,828,567.00	0.30
K	房地产业	1,569,763.00	0.26
L	租赁和商务服务业	916,779.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	3,442,311.54	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	750,796.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	65,564.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	811,328.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	97,948,336.94	16.18

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	300750	宁德时代	48,300	19,402,110.00	3.20
2	600519	贵州茅台	10,500	15,225,000.00	2.51
3	601899	紫金矿业	375,000	12,270,000.00	2.03
4	601318	中国平安	201,100	11,418,458.00	1.89
5	600036	招商银行	202,300	7,954,436.00	1.31
6	601288	农业银行	1,121,700	7,515,390.00	1.24
7	688256	寒武纪	7,642	7,512,086.00	1.24
8	300308	中际旭创	12,800	7,288,448.00	1.20
9	601398	工商银行	943,800	7,210,632.00	1.19
10	601988	中国银行	991,800	5,821,866.00	0.96

#### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	002290	禾盛新材	39,700	2,403,041.00	0.40
2	002048	宁波华翔	83,900	2,155,391.00	0.36
3	603306	华懋科技	28,100	2,124,360.00	0.35
4	301171	易点天下	45,000	2,066,850.00	0.34
5	300005	探路者	109,500	1,631,550.00	0.27

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2606	IC2606	1	1,487,680.00	-150,360.00	-
IF2606	IF2606	4	5,255,040.00	-281,220.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-431,580.00
股指期货投资本期收益 (元)					-173.80
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-431,580.00

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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

招商银行股份有限公司

招商银行股份有限公司及其部分分行或支行存在押品管理不审慎，个人贷款管理不到位；流动性资金贷款贷前调查不尽职、未按照项目进度放款，贷款管理不审慎、贷款“三查”不到位，贷后管理不到位，贷款资金存入定期存款账户、部分贷款资金回流至借款人账户；未按规定对流动资金贷款进行支付管理，未按规定履行客户识别义务；违规提高存款利率，吸收存款；存贷挂钩；违反外汇登记管理规定；违反规定办理资本项目资金收付；违规办理资本金结汇业务、违反规定办理结汇、售汇业务；办理经常项目，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违规办理转贴现业务、瞒报相关信息，贴现交易业务交易背景审查不严等；违规收取受托支付划拨费；办理保函业务不审慎；分支机构违规对同业投资业务进行会计处理；理财投资非标业务风险管理不尽职等；办理货物贸易收付业务未尽审查；允许非商业银行从业人员在商业银行营业场所从事保险销售相关活动；占压财政资金，违反金融统计、账户管理、数据安全、网络安全、反假货币业务、信用信息提供相关规定，信贷资产五级分类不准确、员工行为管理不到位、数据安全管理工作不到位；不良资产处置管理不到位、案件防控管理不到位；国内信用证贸易背景不真实，部分议付资金回流开证人；监管统计报表数据错报、漏报；违反反假货币业务管理规定等问题，在报告编制日前一年内被国家外汇管理局、中国人民银行、国家金融监督管理总局、中国证券监督管理委员会及其派出机构处罚。

中国农业银行股份有限公司

中国农业银行股份有限公司及其部分分行或支行存在贷款管理不审慎；涉企收费不规范，贷款数据不准确，贷款用途监控及支付管理违反监管规定，流动资金贷款“三查”违反监管规定，并购贷款贷前调查不到位，保险销售行为可回溯管理不规范；银行支行及下辖机构发生名称变更、

营业地址变更的，未按规定向所在地外汇局备案；收费质价不符；未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理资本项目资金收付；信用卡分期业务管理不到位；存款考评指标设定不合规；员工合规管理欠缺；向资本金不足且未开工的项目发放贷款；违反清算管理规定；发放无实质用途贷款；隐瞒与保险合同有关的重要情况；信贷资金未按约定用途使用；违规发放固定资产贷款；违规办理货物贸易收汇；因管理不善导致金融许可证遗失；未按照规定报送财务会计报告、统计报表等资料；办理资本金入账登记时间晚于资本金结汇时间违反人民币流通管理规定；代销保险业务管理不到位；违反反假货币业务管理规定；违反规定办理结汇业务；贸易背景审查不严，未按项目进度放款；代理销售保险存在销售误导行为；内控管理不到位，以贷转存；超标准收取提前还款违约金；信用卡分期业务电话营销不规范；现金管理综合服务质价不符；贷款“三查”不到位；办理经常项目业务时，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违规办理资本金收汇业务；违规办理经常项目资金结汇业务；占压财政存款或者资金；未全面落实个人账户分类管理规定；未经客户授权违规开立个人账户；未履行尽职调查义务；未按规定开展客户身份持续识别；未按规定保存客户身份资料；未按规定加强账户监测；违反外汇账户管理规定；信贷资金流向缺乏有效管控，资金流入限制性领域；农户贷款、流动资金贷款、个人经营性贷款贷前调查不尽职、贷后管理不到位；违反信用风险监管规定；违反金融统计相关规定；借贷搭售、贷后管理不到位；保理融资业务“三查”不尽职；违规办理票据业务；关联企业未纳入集团统一授信；未按规定履行客户身份识别义务；违规办理银行卡业务；未经任职资格核准任命高级管理人员；在绩效考核体系外制定考核办法并设立存款时点性考评指标；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等违法违规行为，在报告编制日前一年内被国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局等监管机构及上述机构的派出机构处罚。

#### 中国工商银行股份有限公司

中国工商银行股份有限公司及其部分分行或支行存在金融许可证遗失，损害金融许可证；违反账户管理规定；违反清算管理规定；违反反假货币业务管理规定；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；违反外汇登记管理规定，未按照规定进行国际收支统计申报；办理经常项目收汇业务未对交易单证的真实性进行合理审查，违反规定办理资本项目资金收付，违规办理货物贸易收汇，违规办理经常项目付汇业务，违规办理个人外币现钞提取业务，违规办理经常项目资金收汇，未尽职审查办理收结汇、付汇相关业务；超越授权办理业务；未执行实贷实付；违规办理信用卡汽车专项分期业务；项目贷款管理不尽职、违规收费；贷后管理不到位；项目贷款管理严重不审慎；信贷资金被挪用；展期不合规、贷款五级分类不准确；虚增小微企业贷款；贷后管理不到位，导致信贷资金存入定期存单，严重违反审慎经营规则；虚增存贷款规模；订单融资

业务管理不到位；向关系人发放信用贷款，个人贷款违反审慎经营规则；违规为无真实应收账款借款人办理虚假国内保理；受托支付不合规；占压财政存款或者资金；违反人民币流通管理规定；项目资本金审查不严；违反网络安全管理规定；未按规定履行客户身份识别义务；贷款业务严重违反审慎经营规则；超过借款人实际资金需求发放贷款；贷款业务、保函业务三查违规；委托未通过该机构进行执业登记的个人从事保险代理业务，代销保险误导销售、隐瞒与保险合同有关重要情况；诱导投保人不履行如实告知义务、保险销售行为可回溯管理不规范、未按规定进行执业登记管理；提供虚假的或隐瞒重要事实的统计资料；互联网贷款管理不到位、个人二手住房按揭贷款管理不到位；案防管理不到位，员工行为管控不到位，内控管理不到位；贷款资金流入限制性领域；违反理财产品销售风险匹配原则等问题，在报告编制日前一年内被国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局、中国证券监督管理委员会等监管机构及上述机构的派出机构处罚。

#### 中国银行股份有限公司

中国银行股份有限公司及其部分分行或支行存在违反外汇账户管理规定；贷前调查不尽职、向资本金未到位借款人发放贷款；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理结汇、售汇业务；贷前调查、贷后检查不尽职，未发现贷款资金回流购买理财；从业人员利用职务便利收受贿赂、费用列支真实性要求执行不到位；违规办理资本金结汇业务；流动资金贷款管理不到位；未按规定办理国际收支统计申报；代销保险业务可回溯管理不到位；违反金融统计相关规定；违反银行结算账户管理规定；未按规定履行客户身份识别义务；票据业务贸易背景真实性审核不到位；案件信息迟报；未按规定备案银行结算账户信息；占压财政存款或者资金；未制定本级行金融科技相关制度；员工违规经商办企业；违反国库管理规定；违反固定资产贷款监管规定；未及时披露股份变动情况；超过期限向人民银行报送单位银行结算账户开立备案资料；未向人民银行报送单位银行结算账户开立备案资料；贷前关联企业识别不全，信贷资金流向关联企业；未将投资人长期投资收益纳入分支机构和基金销售人员考核评价指标体系；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；未提供实质性服务收取财务顾问费、项目贷款未约定项目收入账户导致贷后管理不到位；票据业务审查不严，贴现资金回流出票人或保证金来源方；违反金融统计相关规定；贷款“三查”不尽职，违规发放固定资产贷款；贷后管理不到位，固定资产贷款未按约定用途使用；贷后管理不到位，信贷资金被挪用；供应链融资业务办理不审慎；违法违规发放固定资产贷款及流动资金贷款；因管理不善导致金融许可证遗失；未尽职审查办理货物贸易项下收汇；内控管理不到位等问题，在报告编制日前一年内被国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局等监管机构及上述机构的派出机构

处罚。

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。

### 5.11.2 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

本基金投资的前十名股票没有超过基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	809,126.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,207.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,273.80
8	其他	-
9	合计	880,607.52

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.6 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	德邦中证 800 指数增强 A	德邦中证 800 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	749,866,698.03	423,322,974.78
报告期期间基金总申购份额	2,179,734.24	2,289,031.46

减:报告期期间基金总赎回份额	305,577,325.41	249,918,653.34
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	446,469,106.86	175,693,352.90

注:申购含红利再投、转换入份额;赎回含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	德邦中证 800 指数增强 A	德邦中证 800 指数增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	2,999,459.65	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	2,999,459.65	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.67	-

注:申购含红利再投、转换入份额;赎回含转换出份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人运用固有资金投资本基金未发生变动。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件;
- 2、德邦中证 800 指数增强型证券投资基金基金合同;
- 3、德邦中证 800 指数增强型证券投资基金托管协议;
- 4、德邦中证 800 指数增强型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。

## 9.2 存放地点

上海市杨浦区荆州路 198 号万硕大厦 A 栋 25 楼。

## 9.3 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

2026 年 4 月 21 日