

# 德邦价值优选混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2022 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 2022 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                | 12        |
| 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 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <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                        | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>42</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 42        |
| 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       | 43        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 46        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 47        |
| 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      | 47        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 47        |
| 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 ..... | 47        |
| 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 .....    | 47        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 47        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 48        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 48        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>49</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 49        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 49        |
| 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 .....      | 49        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>49</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>50</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 50        |
| 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 .....      | 50        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 50        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 50        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 50        |
| 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 .....         | 50        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 50        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 52        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>54</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 .....    | 54        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 54        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>54</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 54        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 54        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 54        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 德邦价值优选混合型证券投资基金  |                 |
| 基金简称            | 德邦价值优选混合         |                 |
| 基金主代码           | 012437           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2021 年 8 月 12 日  |                 |
| 基金管理人           | 德邦基金管理有限公司       |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 816,346,745.65 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 德邦价值优选混合 A       | 德邦价值优选混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 012437           | 012438          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 782,277,855.32 份 | 34,068,890.33 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金积极优选具备利润创造能力且估值水平具备竞争力的公司，同时精选个股与个券，通过积极的组合管理投资策略，力求实现基金资产超越业绩比较基准的长期稳定增值。  |
| 投资策略   | 本基金基于对经济周期、行业特征与公司价值等宏观、中观、微观层面的信息进行全面分析，确定大类资产配置比例。本基金为混合型基金，将积极配置于股票类资产，同时还将基于经济结构调整过程中的动态变化，通过策略性资产配置把握市场时机，力争实现投资组合的收益最大化。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×25%+恒生指数收益率×5%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可能投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。                      |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                 | 基金托管人               |
|-------------|------|-----------------------|---------------------|
| 名称          |      | 德邦基金管理有限公司            | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张秀玉                   | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-26010852          | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | service@dbfund.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008217788            | 95588               |
| 传真          |      | 021-26010808          | 010-66105798        |

|       |  |                   |
|-------|--|-------------------|
| 注册地址  | 上海市虹口区东大名路 501 号<br>503B 单元            | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址  | 上海市黄浦区中山东二路 600 号<br>S1 幢 2101-2106 单元 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码  | 200010                                 | 100140            |
| 法定代表人 | 左畅                                     | 陈四清               |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年01月01日-2022年06月30日) |                |               |
|---------------|------------------------------|----------------|---------------|
|               | 德邦价值优选混合 A                   | 德邦价值优选混合 C     |               |
| 本期已实现收益       | 27,332,820.96                | 692,302.06     |               |
| 本期利润          | -11,973,187.64               | -109,403.97    |               |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0146                      | -0.0046        |               |
| 本期加权平均净值利润率   | -1.53%                       | -0.49%         |               |
| 本期基金份额净值增长率   | -1.72%                       | -2.11%         |               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日)             |                |               |
|               | 期末可供分配利润                     | 7,560,495.55   | 87,527.74     |
|               | 期末可供分配基金份额利润                 | 0.0097         | 0.0026        |
|               | 期末基金资产净                      | 789,838,350.87 | 34,156,418.07 |

|              |                  |        |
|--------------|------------------|--------|
| 值            |                  |        |
| 期末基金份额净值     | 1.0097           | 1.0026 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年6月30日) |        |
| 基金份额累计净值增长率  | 0.97%            | 0.26%  |

注：1、本基金合同生效日为 2021 年 8 月 12 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间尚不满一年。

2、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。

3、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）。

4、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

德邦价值优选混合 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月      | 8.92%    | 1.00%       | 6.72%      | 0.82%         | 2.20% | 0.18% |
| 过去三个月      | 11.98%   | 1.33%       | 4.49%      | 1.07%         | 7.49% | 0.26% |
| 过去六个月      | -1.72%   | 1.49%       | -6.50%     | 1.10%         | 4.78% | 0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.97%    | 1.19%       | -7.90%     | 0.92%         | 8.87% | 0.27% |

德邦价值优选混合 C

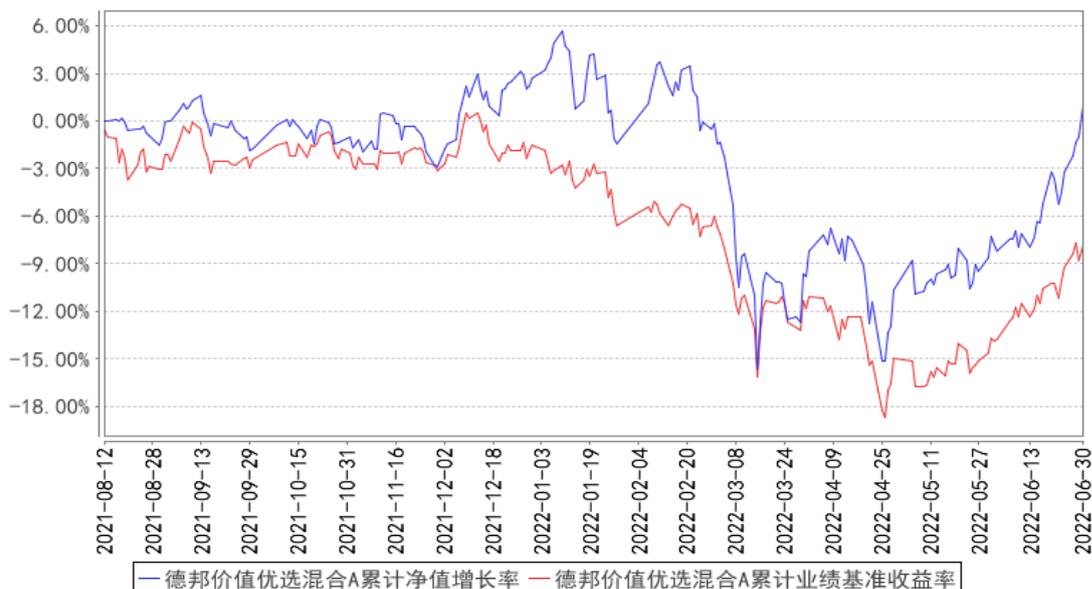
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

|            |        |       |        |       |       |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去一个月      | 8.85%  | 1.00% | 6.72%  | 0.82% | 2.13% | 0.18% |
| 过去三个月      | 11.76% | 1.33% | 4.49%  | 1.07% | 7.27% | 0.26% |
| 过去六个月      | -2.11% | 1.49% | -6.50% | 1.10% | 4.39% | 0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.26%  | 1.18% | -7.90% | 0.92% | 8.16% | 0.26% |

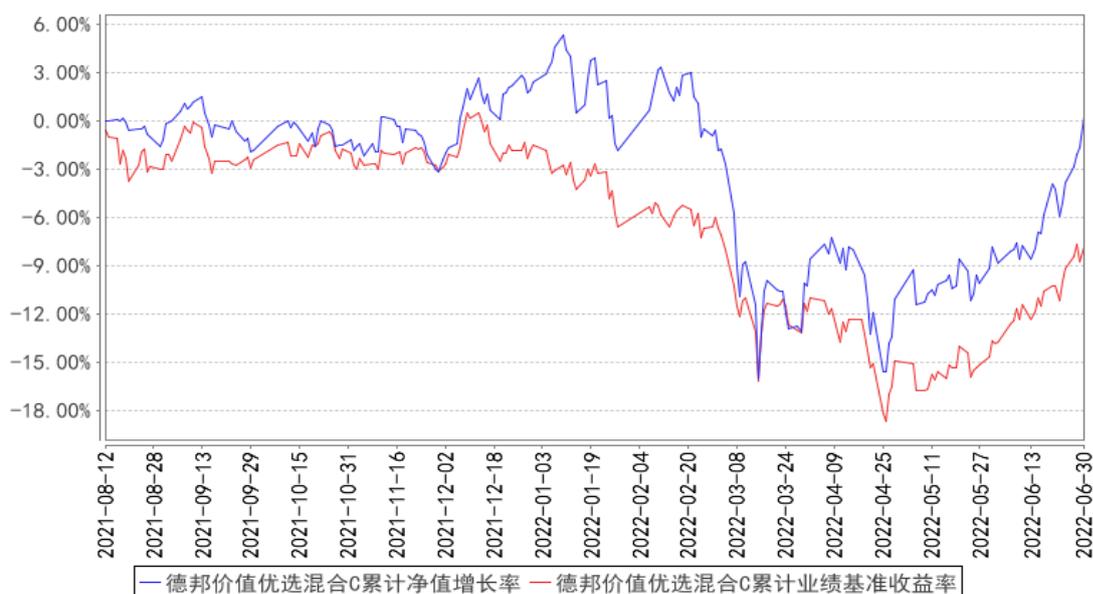
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中债综合全价指数收益率×25%+恒生指数收益率×5%

### 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

德邦价值优选混合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



德邦价值优选混合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：本基金基金合同生效日为 2021 年 08 月 12 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。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 08 月 12 日至 2022 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。成立十年，德邦基金不忘“为持有人提供优质的资产管理服务”之初心，始终秉持长期价值投资理念，坚守审慎的合规风控底线，锻造持续精进的投研专业实力，力求不断提升客户的财富管理体验，打造以“专业”和“陪伴”为特色的稳健发展的公募基金百年老店。

截止 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理三十六只开放式基金：德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、德邦福鑫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、德邦新添利债券型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦如意货币市场基金、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、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦锐乾债券型证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦量化优选股票型证券投资基金基金（LOF）、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、德邦锐泓债券型证

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、德邦短债债券型证券投资基金、德邦锐恒 39 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦安鑫混合型证券投资基金、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、德邦安益 6 个月持有期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、德邦锐祥债券型证券投资基金、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 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、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及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 |        |   |
| 黎莹 | 本基金的基金经理 | 2021 年 8 月 12 日 | -    | 12 年   | 硕士，2010 年 4 月至 2014 年 4 月担任群益证券研究部研究员。2014 年 4 月加入德邦基金管理有限公司，现任德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦新添利债券型证券投资基金、德邦乐享生活混合型证券投资基金、德邦大消费混合型证券投资基金、德邦科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、德邦价值优选混合型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《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司

内部相关制度规定，对投资交易行为进行监察稽核，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，借助 IT 系统和人工监控等方式在各个环节严格控制交易公平执行；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易制度的执行和实现。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况，且未发现其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场弱势调整，同时呈现大幅波动的走势。上证综指下跌 1.0%，沪深 300 指数下跌 2.3%，深成指下跌 7.6%，创业板指下跌 11.3%。分板块来看，采掘、休闲服务和建筑装饰板块领涨，电子、军工和计算机板块跌幅靠前。

今年年初以来，股票市场经历了美联储货币收紧，俄乌战争和国内疫情扩散等多基本面因素的共振，大幅调整向下。不过随着国内疫情的逐步缓解，复工复产的稳步推进，经济压力最大阶段逐步过渡，同时海外流动性预期压力测试也逐步消化，市场从 4 月底迎来国内经济弱复苏，流动性友好带来的反弹。德邦价值优选主要配置为估值合理的优质龙头企业，基本面良好，获取稳健的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末德邦价值优选混合 A 基金份额净值为 1.0097 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.72%；截至本报告期末德邦价值优选混合 C 基金份额净值为 1.0026 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.11%；同期业绩比较基准收益率为-6.50%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 6 月经济数据看，目前环比修复仍在继续，出口、工业、服务业、投资、消费、地产销售同比增速均好于前值；7 月以来数据相对积极，包括超预期的 6 月社融、中长期贷款和出口，回升中的消费；逻辑受到的主要扰动是地产的销售波动，以及新开工、投资等的继续回落。近期媒体又爆出多起期房业主强制停贷的事件，针对停贷事件目前银保监会和地方政府已积极推进‘保

交楼、保民生、保稳定’工作，预计影响大概率将不会进一步扩散。虽然经济修复幅度的不确定提高，但弱修复方向不会变化，从下半年维度来看，维持底部震荡偏乐观。后续市场风格判断不会单边成长或价值风格，都会有阶段性表现，动态比较性价比优势。

#### 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《德邦基金基金估值业务管理制度》、《德邦基金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。公司估值委员会成员包括总经理、分管投资副总或投资总监、督察长、基金经理、股票投资一部、股票投资二部、量化投资部、海外与组合投资部、股票研究部、公募固收投资部、固收研究部、基金运营部及监察稽核部等相关专业人士组成。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议批准后执行。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人会对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人人数不满二百人或基金资产净值低于五千万的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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，不存在任何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合规守信、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、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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本基金 2022 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核查，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：德邦价值优选混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 65,720,750.75          | 184,112,328.29           |
| 结算备付金      |         | 646,364.94             | 482,775.39               |
| 存出保证金      |         | 128,734.87             | 179,405.41               |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 754,051,052.27         | 1,047,964,115.24         |
| 其中：股票投资    |         | 754,051,052.27         | 1,047,964,115.24         |
| 基金投资       |         | -                      | -                        |
| 债券投资       |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资      |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 债权投资       | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 其中：债券投资    |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资   |         | -                      | -                        |
| 其他投资       |         | -                      | -                        |
| 其他债权投资     | 6.4.7.6 | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资   | 6.4.7.7 | -                      | -                        |
| 应收清算款      |         | 1,372,419.60           | -                        |
| 应收股利       |         | -                      | -                        |
| 应收申购款      |         | 5,111,077.30           | 6,539.66                 |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | 84,751.80                   |
| 资产总计          |            | 827,030,399.73            | 1,232,829,915.79            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2021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         |            | 0.82                      | 5,522,205.08                |
| 应付赎回款         |            | 1,460,219.73              | 10,618,923.29               |
| 应付管理人报酬       |            | 938,035.41                | 1,644,808.55                |
| 应付托管费         |            | 156,339.23                | 274,134.77                  |
| 应付销售服务费       |            | 14,400.31                 | 20,528.22                   |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | -                         | -                           |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 466,635.29                | 658,421.17                  |
| 负债合计          |            | 3,035,630.79              | 18,739,021.08               |
| <b>净资产:</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 816,346,745.65            | 1,181,839,520.26            |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 7,648,023.29              | 32,251,374.45               |
| 净资产合计         |            | 823,994,768.94            | 1,214,090,894.71            |
| 负债和净资产总计      |            | 827,030,399.73            | 1,232,829,915.79            |

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，德邦价值优选混合 A 基金份额净值 1.0097 元，基金份额总额 782,277,855.32 份；德邦价值优选混合 C 基金份额净值 1.0026 元，基金份额总额 34,068,890.33 份。德邦价值优选混合份额总额合计 816,346,745.65 份。

（2）以下比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：德邦价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                             | 附注号        | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6<br>月 30 日 |
|---------------------------------|------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>                  |            | -4,866,316.29                            |
| 1. 利息收入                         |            | 180,097.72                               |
| 其中：存款利息收入                       | 6.4.7.13   | 180,097.72                               |
| 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）               |            | 34,203,940.24                            |
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.14   | 23,050,517.55                            |
| 基金投资收益                          |            | -  |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.15   | -  |
| 资产支持证券投资收益                      | 6.4.7.16   | -  |
| 贵金属投资收益                         | 6.4.7.17   | -  |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.18   | -  |
| 股利收益                            | 6.4.7.19   | 11,153,422.69                            |
| 以摊余成本计量的金融资产<br>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<br>填列）      | 6.4.7.20   | -40,107,714.63                           |
| 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   | 857,360.38                               |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 7,216,275.32                             |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 6,007,762.80                             |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 1,001,293.79                             |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | 89,129.14                                |
| 4. 投资顾问费                        |            | -  |
| 5. 利息支出                         |            | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出                   |            | -  |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.22   | -  |
| 7. 税金及附加                        |            | -  |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.23   | 118,089.59                               |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号<br/>填列）</b> |            | -12,082,591.61                           |
| 减：所得税费用                         |            | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>        |            | -12,082,591.61                           |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>            |            | -  |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | -12,082,591.61                           |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：德邦价值优选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>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)                     | 1,181,839,520.26                      | -      | 32,251,374.45  | 1,214,090,894.71 |
| 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)                     | 1,181,839,520.26                      | -      | 32,251,374.45  | 1,214,090,894.71 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -365,492,774.61                       | -      | -24,603,351.16 | -390,096,125.77  |
| (一)、综合收益总额                          | -                                     | -      | -12,082,591.61 | -12,082,591.61   |
| (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) | -365,492,774.61                       | -      | -12,520,759.55 | -378,013,534.16  |
| 其中：1. 基金申                           | 30,032,242.42                         | -      | -1,246,287.17  | 28,785,955.25    |

|  |                 |   |                |                 |
|--|-----------------|---|----------------|-----------------|
| 购款   |                 |   |                |                 |
| 2<br>. 基金赎回款                                 | -395,525,017.03 | - | -11,274,472.38 | -406,799,489.41 |
| (三)、<br>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)、<br>其他综合收益结转留存收益                         | -               | - | -              | -               |
| 四、本期末净资产(基金净值)                               | 816,346,745.65  | - | 7,648,023.29   | 823,994,768.94  |

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：

张騷

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

德邦价值优选混合型证券投资基金(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]1533 号文《关于准予德邦价值优选混合型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 2021 年 7 月 28 日至 2021 年 8 月 10 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\_B03 号后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2021 年 8 月 12 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 1,349,419,988.09 元,在募集期间产生的利息为人民币 292,163.10 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 1,349,712,151.19 元,折合 1,349,712,151.19 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,基金托管人为中国工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,包括国内依法发行上市的股票(含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(简称:“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、股指期货、股票期权、国债期货、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 70%+中债综合全价指数收益率 $\times$ 25%+恒生指数收益率 $\times$ 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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与最近一期年度报告不一致,详见 6.4.5.1 会计政策变更的说明,本报告期所采用的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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 184,112,328.29 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 21,318.76 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 184,133,647.05 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 482,775.39 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 63,352.34 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 546,127.73 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 179,405.41 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 80.70 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 179,486.11 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 84,751.80 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 21,318.76 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 63,352.34 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 80.70 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品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暂行条例（2011 年修订）》、《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<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 65,720,750.75          |
| 等于：本金          | 65,714,683.95          |
| 加：应计利息         | 6,066.80               |
| 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     | 65,720,750.75 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2022年6月30日 |      |                |                |
|-------------------|-------------------|------|----------------|----------------|
|                   | 成本                | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票                | 787,281,356.20    | -    | 754,051,052.27 | -33,230,303.93 |
| 贵金属投资-金交所<br>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                | 787,281,356.20    | -    | 754,051,052.27 | -33,230,303.93 |

#### 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债权投资。

**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债权投资。

**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其他债权投资。

**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其他债权投资。

**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其他权益工具投资。

**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其他权益工具投资。

**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<br>2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 6.69              |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 272,490.25        |
| 其中：交易所市场    | 272,490.25        |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 应付审计费       | 134,630.98        |
| 应付信息披露费     | 59,507.37         |
| 合计          | 466,635.29        |

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

## 德邦价值优选混合 A

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                  |
|---------------|----------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,154,450,163.49           | 1,154,450,163.49 |
| 本期申购          | 13,334,695.29              | 13,334,695.29    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -385,507,003.46            | -385,507,003.46  |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 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           | 782,277,855.32 | 782,277,855.32 |

## 德邦价值优选混合 C

| 项目            | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 27,389,356.77              | 27,389,356.77  |
| 本期申购          | 16,697,547.13              | 16,697,547.13  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -10,018,013.57             | -10,018,013.57 |
| 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           | 34,068,890.33              | 34,068,890.33  |

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

## 德邦价值优选混合 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初           | 25,280,205.94  | 6,308,856.54   | 31,589,062.48  |
| 本期利润           | 27,332,820.96  | -39,306,008.60 | -11,973,187.64 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -10,964,682.78 | -1,090,696.51  | -12,055,379.29 |
| 其中：基金申购款       | 610,547.10     | -1,203,469.91  | -592,922.81    |
| 基金赎回款          | -11,575,229.88 | 112,773.40     | -11,462,456.48 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 41,648,344.12  | -34,087,848.57 | 7,560,495.55   |

## 德邦价值优选混合 C

| 项目             | 已实现部分       | 未实现部分         | 未分配利润合计     |
|----------------|-------------|---------------|-------------|
| 本期期初           | 513,809.89  | 148,502.08    | 662,311.97  |
| 本期利润           | 692,302.06  | -801,706.03   | -109,403.97 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 369,320.70  | -834,700.96   | -465,380.26 |
| 其中：基金申购款       | 766,668.94  | -1,420,033.30 | -653,364.36 |
| 基金赎回款          | -397,348.24 | 585,332.34    | 187,984.10  |
| 本期已分配利润        | -           | -             | -           |

|     |              |               |           |
|-----|--------------|---------------|-----------|
| 本期末 | 1,575,432.65 | -1,487,904.91 | 87,527.74 |
|-----|--------------|---------------|-----------|

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |            |
|-----------|----------------------|------------|
|           | 2022年1月1日至2022年6月30日 |            |
| 活期存款利息收入  |                      | 171,229.62 |
| 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 |                      | 7,287.77   |
| 其他        |                      | 1,580.33   |
| 合计        |                      | 180,097.72 |

#### 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                   |               |
|------------------|----------------------|---------------|
|                  | 2022年1月1日至2022年6月30日 |               |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 |                      | 23,050,517.55 |
| 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               |                      | 23,050,517.55 |

##### 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                   |                |
|------------|----------------------|----------------|
|            | 2022年1月1日至2022年6月30日 |                |
| 卖出股票成交总额   |                      | 521,783,068.79 |
| 减：卖出股票成本总额 |                      | 497,469,935.60 |
| 减：交易费用     |                      | 1,262,615.64   |
| 买卖股票差价收入   |                      | 23,050,517.55  |

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**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。

**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。

**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。

**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。

**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买卖权证差价收入。

**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其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

|               |               |
|---------------|---------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 11,153,422.69 |
| 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            | 11,153,422.69 |

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -40,107,714.63             |
| 股票投资                   | -40,107,714.63             |
| 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                     | -40,107,714.63             |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 857,331.27                 |
| 基金转换费收入 | 29.11                      |
| 合计      | 857,360.38                 |

#### 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 44,630.98                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 银行汇划费用  | 4,951.24                   |
| 账户维护费   | 9,000.00                   |
| 合计      | 118,089.59                 |

## 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 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 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 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

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末无应支付关联方的佣金。

### 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<br>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 | 6,007,762.80               |

|                 |              |
|-----------------|--------------|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,885,995.93 |
|-----------------|--------------|

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              |
|----------------|---------------------------------|
|                | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,001,293.79                    |

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |            |           |
|----------------|---------------------------------|------------|-----------|
|                | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|                | 德邦价值优选混合 A                      | 德邦价值优选混合 C | 合计        |
| 德邦基金           | -                               | 11.29      | 11.29     |
| 德邦证券           | -                               | 3,964.55   | 3,964.55  |
| 工商银行           | -                               | 24,772.99  | 24,772.99 |
| 合计             | -                               | 28,748.83  | 28,748.83 |

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 类基金份额销售服务费年费率为 0.80%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金本报告期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：本基金本报告期末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：本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

| 项目                         | 本期                   | 本期                   |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
|                            | 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 |
|                            | 德邦价值优选混合 A           | 德邦价值优选混合 C           |
| 基金合同生效日（2021年8月12日）持有的基金份额 | -                    | -                    |
| 报告期初持有的基金份额                | 4,999,000.00         | -                    |
| 报告期间申购/买入总份额               | 0.00                 | -                    |
| 报告期间因拆分变动份额                | 0.00                 | -                    |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额             | 0.00                 | -                    |
| 报告期末持有的基金份额                | 4,999,000.00         | -                    |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 0.6100%              | -                    |

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                   |            |
|-------|----------------------|------------|
|       | 2022年1月1日至2022年6月30日 |            |
|       | 期末余额                 | 当期利息收入     |
| 工商银行  | 65,720,750.75        | 171,229.62 |

**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：本基金本报告期末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(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |     |        |       |        |              |           |           |    |
|----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 300834               | 星辉环材 | 2022年1月6日  | 6个月 | 新股流通受限 | 55.57 | 30.03  | 635          | 35,286.95 | 19,069.05 | -  |
| 301102               | 兆讯传媒 | 2022年3月15日 | 6个月 | 新股流通受限 | 39.88 | 31.09  | 642          | 25,602.96 | 19,959.78 | -  |
| 301103               | 何氏眼科 | 2022年3月14日 | 6个月 | 新股流通受限 | 32.69 | 32.02  | 507          | 16,575.00 | 16,234.14 | -  |
| 301110               | 青木股份 | 2022年3月4日  | 6个月 | 新股流通受限 | 63.10 | 39.85  | 202          | 12,746.20 | 8,049.70  | -  |
| 301112               | 信邦智能 | 2022年6月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 27.53 | 45.04  | 399          | 10,984.47 | 17,970.96 | -  |
| 301116               | 益客食品 | 2022年1月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.40 | 20.46  | 577          | 6,577.80  | 11,805.42 | -  |
| 301117               | 佳缘科技 | 2022年1月7日  | 6个月 | 新股流通受限 | 46.80 | 54.44  | 262          | 12,261.60 | 14,263.28 | -  |
| 301123               | 奕东电子 | 2022年1月14日 | 6个月 | 新股流通受限 | 37.23 | 25.39  | 656          | 24,422.88 | 16,655.84 | -  |
| 301125               | 腾亚精工 | 2022年5月27日 | 6个月 | 新股流通受限 | 22.49 | 27.42  | 327          | 7,354.23  | 8,966.34  | -  |
| 301130               | 西点   | 2022年      | 6个月 | 新股流    | 22.55 | 37.70  | 237          | 5,344.35  | 8,934.90  | -  |

|        |      |            |         |        |       |       |       |            |            |  |   |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|-------|------------|------------|--|---|
|        | 药业   | 2月16日      |         | 通受限    |       |       |       |            |            |  |   |
| 301135 | 瑞德智能 | 2022年4月1日  | 6个月     | 新股流通受限 | 31.98 | 26.26 | 338   | 10,809.24  | 8,875.88   |  | - |
| 301137 | 哈焊华通 | 2022年3月14日 | 6个月     | 新股流通受限 | 15.37 | 15.99 | 644   | 9,898.28   | 10,297.56  |  | - |
| 301139 | 元道通信 | 2022年6月30日 | 1个月内(含) | 新股未上市  | 38.46 | 38.46 | 5,651 | 217,337.46 | 217,337.46 |  | - |
| 301151 | 冠龙节能 | 2022年3月30日 | 6个月     | 新股流通受限 | 30.82 | 21.46 | 703   | 21,666.46  | 15,086.38  |  | - |
| 301153 | 中科江南 | 2022年5月10日 | 6个月     | 新股流通受限 | 33.68 | 43.98 | 398   | 13,404.64  | 17,504.04  |  | - |
| 301158 | 德石股份 | 2022年1月7日  | 6个月     | 新股流通受限 | 15.64 | 20.38 | 379   | 5,927.56   | 7,724.02   |  | - |
| 301162 | 国能日新 | 2022年4月19日 | 6个月     | 新股流通受限 | 45.13 | 54.11 | 334   | 15,073.42  | 18,072.74  |  | - |
| 301181 | 标榜股份 | 2022年2月11日 | 6个月     | 新股流通受限 | 40.25 | 30.59 | 257   | 10,344.25  | 7,861.63   |  | - |
| 301196 | 唯科科技 | 2022年1月4日  | 6个月     | 新股流通受限 | 64.08 | 37.52 | 271   | 17,365.68  | 10,167.92  |  | - |
| 301200 | 大族数控 | 2022年2月18日 | 6个月     | 新股流通受限 | 76.56 | 51.92 | 532   | 40,729.92  | 27,621.44  |  | - |
| 301201 | 诚达药业 | 2022年1月12日 | 6个月     | 新股流通受限 | 72.69 | 71.54 | 353   | 25,659.57  | 25,253.62  |  | - |
| 301207 | 华兰疫苗 | 2022年2月10日 | 6个月     | 新股流通受限 | 56.88 | 56.42 | 356   | 20,249.28  | 20,085.52  |  | - |
| 301216 | 万凯新材 | 2022年3月21日 | 6个月     | 新股流通受限 | 35.68 | 29.84 | 784   | 27,973.12  | 23,394.56  |  | - |
| 301217 | 铜冠铜箔 | 2022年1月20日 | 6个月     | 新股流通受限 | 17.27 | 14.83 | 2,456 | 42,415.12  | 36,422.48  |  | - |

|        |          |                    |             |            |       |       |       |            |            |   |
|--------|----------|--------------------|-------------|------------|-------|-------|-------|------------|------------|---|
| 301219 | 腾远<br>钴业 | 2022年<br>3月10<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 96.56 | 87.82 | 209   | 20,181.68  | 18,354.38  | - |
| 301222 | 浙江<br>恒威 | 2022年<br>3月2<br>日  | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 33.98 | 28.96 | 332   | 11,281.36  | 9,614.72   | - |
| 301233 | 盛帮<br>股份 | 2022年<br>6月24<br>日 | 1个月<br>内(含) | 新股未<br>上市  | 41.52 | 41.52 | 1,418 | 58,875.36  | 58,875.36  | - |
| 301233 | 盛帮<br>股份 | 2022年<br>6月24<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 41.52 | 41.52 | 158   | 6,560.16   | 6,560.16   | - |
| 301235 | 华康<br>医疗 | 2022年<br>1月21<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 39.30 | 37.93 | 418   | 16,427.40  | 15,854.74  | - |
| 301236 | 软通<br>动力 | 2022年<br>3月8<br>日  | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 48.59 | 31.38 | 1,131 | 54,951.52  | 35,490.78  | - |
| 301237 | 和顺<br>科技 | 2022年<br>3月16<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 56.69 | 41.86 | 261   | 14,796.09  | 10,925.46  | - |
| 301238 | 瑞泰<br>新材 | 2022年<br>6月10<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 19.18 | 32.07 | 1,998 | 38,321.64  | 64,075.86  | - |
| 301239 | 普瑞<br>眼科 | 2022年<br>6月22<br>日 | 1个月<br>内(含) | 新股未<br>上市  | 33.65 | 33.65 | 5,172 | 174,037.80 | 174,037.80 | - |
| 301239 | 普瑞<br>眼科 | 2022年<br>6月22<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 33.65 | 33.65 | 575   | 19,348.75  | 19,348.75  | - |
| 301258 | 富士<br>莱  | 2022年<br>3月21<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 48.30 | 41.68 | 295   | 14,248.50  | 12,295.60  | - |
| 301263 | 泰恩<br>康  | 2022年<br>3月22<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 19.93 | 31.38 | 682   | 13,592.26  | 21,401.16  | - |
| 301286 | 侨源<br>股份 | 2022年<br>6月6<br>日  | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 16.91 | 19.79 | 784   | 13,257.44  | 15,515.36  | - |
| 301302 | 华如<br>科技 | 2022年<br>6月16<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 52.03 | 56.42 | 466   | 24,245.98  | 26,291.72  | - |
| 688150 | 莱特<br>光电 | 2022年<br>3月10<br>日 | 6个月         | 新股流<br>通受限 | 22.05 | 19.60 | 5,626 | 124,053.30 | 110,269.60 | - |

|        |      |            |         |        |       |       |        |            |            |   |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|--------|------------|------------|---|
|        |      | 日          |         |        |       |       |        |            |            |   |
| 688237 | 超卓航科 | 2022年6月24日 | 1个月内(含) | 新股未上市  | 41.27 | 41.27 | 2,891  | 119,311.57 | 119,311.57 | - |
| 688259 | 创耀科技 | 2022年1月5日  | 6个月     | 新股流通受限 | 66.60 | 79.22 | 1,595  | 106,227.00 | 126,355.90 | - |
| 688270 | 臻镭科技 | 2022年1月20日 | 6个月     | 新股流通受限 | 61.88 | 59.87 | 3,705  | 229,265.40 | 221,818.35 | - |
| 688400 | 凌云光  | 2022年6月27日 | 1个月内(含) | 新股未上市  | 21.93 | 21.93 | 13,111 | 287,524.23 | 287,524.23 | - |

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，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 2022 年 6 月 30 日止，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之内。

#### 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 2022 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（2021 年 12 月 31 日，同）。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末以及上期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期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期末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末以及上期末均未持有按长期信用评级列示的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上期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期末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 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 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。

本基金所持的部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 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受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<br>2022年6月30<br>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                    | 65,720,750.75  | -     | -      | -    | -    | -                | 65,720,750.75    |
| 结算备付金                   | 646,364.94     | -     | -      | -    | -    | -                | 646,364.94       |
| 存出保证金                   | -              | -     | -      | -    | -    | 128,734.87       | 128,734.87       |
| 交易性金融资产                 | -              | -     | -      | -    | -    | 754,051,052.27   | 754,051,052.27   |
| 应收申购款                   | -              | -     | -      | -    | -    | 5,111,077.30     | 5,111,077.30     |
| 应收清算款                   | -              | -     | -      | -    | -    | 1,372,419.60     | 1,372,419.60     |
| 资产总计                    | 66,367,115.69  | -     | -      | -    | -    | 760,663,284.04   | 827,030,399.73   |
| 负债                      |                |       |        |      |      |                  |                  |
| 应付赎回款                   | -              | -     | -      | -    | -    | 1,460,219.73     | 1,460,219.73     |
| 应付管理人报酬                 | -              | -     | -      | -    | -    | 938,035.41       | 938,035.41       |
| 应付托管费                   | -              | -     | -      | -    | -    | 156,339.23       | 156,339.23       |
| 应付清算款                   | -              | -     | -      | -    | -    | 0.82             | 0.82             |
| 应付销售服务费                 | -              | -     | -      | -    | -    | 14,400.31        | 14,400.31        |
| 其他负债                    | -              | -     | -      | -    | -    | 466,635.29       | 466,635.29       |
| 负债总计                    | -              | -     | -      | -    | -    | 3,035,630.79     | 3,035,630.79     |
| 利率敏感度缺口                 | 66,367,115.69  | -     | -      | -    | -    | 757,627,653.25   | 823,994,768.94   |
| 上年度末<br>2021年12月<br>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                    | 184,112,328.29 | -     | -      | -    | -    | -                | 184,112,328.29   |
| 结算备付金                   | 482,775.39     | -     | -      | -    | -    | -                | 482,775.39       |
| 存出保证金                   | 179,405.41     | -     | -      | -    | -    | -                | 179,405.41       |
| 交易性金融资产                 | -              | -     | -      | -    | -    | 1,047,964,115.24 | 1,047,964,115.24 |
| 应收申购款                   | -              | -     | -      | -    | -    | 6,539.66         | 6,539.66         |
| 其他资产                    | -              | -     | -      | -    | -    | 84,751.80        | 84,751.80        |
| 资产总计                    | 184,774,509.09 | -     | -      | -    | -    | 1,048,055,406.70 | 1,232,829,915.79 |
| 负债                      |                |       |        |      |      |                  |                  |

|         |                |   |   |   |   |                   |                  |
|---------|----------------|---|---|---|---|-------------------|------------------|
| 应付证券清算款 | -              | - | - | - | - | 5,522,205.08      | 5,522,205.08     |
| 应付赎回款   | -              | - | - | - | - | 10,618,923.29     | 10,618,923.29    |
| 应付管理人报酬 | -              | - | - | - | - | 1,644,808.55      | 1,644,808.55     |
| 应付托管费   | -              | - | - | - | - | 274,134.77        | 274,134.77       |
| 应付销售服务费 | -              | - | - | - | - | 20,528.22         | 20,528.22        |
| 其他负债    | -              | - | - | - | - | 658,421.17        | 658,421.17       |
| 负债总计    | -              | - | - | - | - | 18,739,021.08     | 18,739,021.08    |
| 利率敏感度缺口 | 184,774,509.09 | - | - | - | - | -1,029,316,385.62 | 1,214,090,894.71 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，（2021 年 12 月 31 日：同）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。（2021 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |              |                |              |
|---------------|------------------------|--------------|----------------|--------------|
|               | 美元<br>折合人民币<br>元       | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计           |
| 以外币计价的资产      |                        |              |                |              |
| 交易性金融资产       | -                      | 3,737,180.30 | -              | 3,737,180.30 |
| 资产合计          | -                      | 3,737,180.30 | -              | 3,737,180.30 |
| 以外币计价的负债      |                        |              |                |              |
| 负债合计          | -                      | -            | -              | -            |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                      | 3,737,180.30 | -              | 3,737,180.30 |

| 项目                    | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |              |                |    |
|-----------------------|--------------------------|--------------|----------------|----|
|                       | 美元<br>折合人民币<br>元         | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |              |                |    |
| 资产合计                  | -                        | -            | -              | -  |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |              |                |    |
| 负债合计                  | -                        | -            | -              | -  |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | -            | -              | -  |

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

##### 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<br>2022 年 6 月 30 日 |                   | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                   |
|--------------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|                    | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产<br>— 股票投资  | 754,051,052.27         | 91.51             | 1,047,964,115.24         | 86.32             |
| 交易性金融资产<br>— 基金投资  | -                      | -                 | -                        | -                 |
| 交易性金融资产<br>— 贵金属投资 | -                      | -                 | -                        | -                 |
| 衍生金融资产—<br>权证投资    | -                      | -                 | -                        | -                 |
| 其他                 | -                      | -                 | -                        | -                 |
| 合计                 | 754,051,052.27         | 91.51             | 1,047,964,115.24         | 86.32             |

##### 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。 |                             |                   |
|    | 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（2022年6月30日）             | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 沪深 300 上升 1%                         | 6,589,943.71                | 6,243,842.90      |
|    | 沪深 300 下降 1%                         | -6,589,943.71               | -6,243,842.90     |

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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 752,109,516.11    | 1,045,060,211.23    |
| 第二层次          | 882,995.33        | 319,694.19          |
| 第三层次          | 1,058,540.83      | 2,584,209.82        |
| 合计            | 754,051,052.27    | 1,047,964,115.24    |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于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              | 754,051,052.27 | 91.18         |
|    | 其中：股票             | 754,051,052.27 | 91.18         |
| 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      | 66,367,115.69  | 8.02          |
| 8  | 其他各项资产            | 6,612,231.77   | 0.80          |
| 9  | 合计                | 827,030,399.73 | 100.00        |

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 3,737,180.30 元，占总净值的比例为 0.45%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别          | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|---------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业      | -              | -             |
| B  | 采矿业           | 13,155,300.00  | 1.60          |
| C  | 制造业           | 557,416,321.57 | 67.65         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和 | 24,696,000.00  | 3.00          |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
|   | 供应业             |                |       |
| E | 建筑业             |                | -     |
| F | 批发和零售业          | 21,401.16      | 0.00  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 45,183,411.00  | 5.48  |
| H | 住宿和餐饮业          | 15,021,023.20  | 1.82  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 463,365.62     | 0.06  |
| J | 金融业             |                | -     |
| K | 房地产业            | 90,421,614.21  | 10.97 |
| L | 租赁和商务服务业        | 19,959.78      | 0.00  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 15,854.74      | 0.00  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 3,690,000.00   | 0.45  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   |                | -     |
| P | 教育              |                | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | 209,620.69     | 0.03  |
| R | 文化、体育和娱乐业       |                | -     |
| S | 综合              |                | -     |
|   | 合计              | 750,313,871.97 | 91.06 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|--------------|--------------|
| 原材料      | -            | -            |
| 非日常生活消费品 | -            | -            |
| 日常消费品    | -            | -            |
| 能源       | -            | -            |
| 金融       | -            | -            |
| 医疗保健     | -            | -            |
| 工业       | -            | -            |
| 信息技术     | -            | -            |
| 通信服务     | 3,737,180.30 | 0.45         |
| 公用事业     | -            | -            |
| 房地产      | -            | -            |
| 合计       | 3,737,180.30 | 0.45         |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 000002 | 万科 A | 3,079,100 | 63,121,550.00 | 7.66         |
| 2  | 002250 | 联化科技 | 3,802,547 | 62,247,694.39 | 7.55         |
| 3  | 002508 | 老板电器 | 1,190,000 | 42,875,700.00 | 5.20         |
| 4  | 600176 | 中国巨石 | 2,225,000 | 38,737,250.00 | 4.70         |
| 5  | 600309 | 万华化学 | 395,552   | 38,364,588.48 | 4.66         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 6  | 600009 | 上海机场 | 557,300   | 31,598,910.00 | 3.83 |
| 7  | 600585 | 海螺水泥 | 820,000   | 28,929,600.00 | 3.51 |
| 8  | 000786 | 北新建材 | 811,900   | 28,107,978.00 | 3.41 |
| 9  | 601985 | 中国核电 | 3,600,000 | 24,696,000.00 | 3.00 |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药 | 602,600   | 22,350,434.00 | 2.71 |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 600,000   | 20,232,000.00 | 2.46 |
| 12 | 002706 | 良信股份 | 1,170,000 | 19,340,100.00 | 2.35 |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 319,997   | 19,324,618.83 | 2.35 |
| 14 | 002572 | 索菲亚  | 646,500   | 17,778,750.00 | 2.16 |
| 15 | 603517 | 绝味食品 | 298,600   | 17,265,052.00 | 2.10 |
| 16 | 600383 | 金地集团 | 1,260,000 | 16,934,400.00 | 2.06 |
| 17 | 600801 | 华新水泥 | 860,300   | 16,784,453.00 | 2.04 |
| 18 | 300699 | 光威复材 | 280,000   | 16,483,600.00 | 2.00 |
| 19 | 601233 | 桐昆股份 | 1,000,000 | 15,880,000.00 | 1.93 |
| 20 | 600754 | 锦江酒店 | 238,808   | 15,021,023.20 | 1.82 |
| 21 | 002493 | 荣盛石化 | 911,000   | 14,020,290.00 | 1.70 |
| 22 | 000739 | 普洛药业 | 678,610   | 14,006,510.40 | 1.70 |
| 23 | 603225 | 新凤鸣  | 1,200,000 | 13,848,000.00 | 1.68 |
| 24 | 603520 | 司太立  | 488,000   | 13,722,560.00 | 1.67 |
| 25 | 600004 | 白云机场 | 911,100   | 13,584,501.00 | 1.65 |
| 26 | 601899 | 紫金矿业 | 1,410,000 | 13,155,300.00 | 1.60 |
| 27 | 002304 | 洋河股份 | 49,900    | 9,139,185.00  | 1.11 |
| 28 | 603866 | 桃李面包 | 543,047   | 8,987,427.85  | 1.09 |
| 29 | 601877 | 正泰电器 | 249,939   | 8,942,817.42  | 1.09 |
| 30 | 001979 | 招商蛇口 | 561,347   | 7,538,890.21  | 0.91 |
| 31 | 600521 | 华海药业 | 310,000   | 7,037,000.00  | 0.85 |
| 32 | 603317 | 天味食品 | 243,900   | 6,943,833.00  | 0.84 |
| 33 | 600346 | 恒力石化 | 300,000   | 6,672,000.00  | 0.81 |
| 34 | 300760 | 迈瑞医疗 | 20,000    | 6,264,000.00  | 0.76 |
| 35 | 603786 | 科博达  | 100,000   | 6,157,000.00  | 0.75 |
| 36 | 600872 | 中炬高新 | 167,600   | 5,800,636.00  | 0.70 |
| 37 | 600862 | 中航高科 | 200,000   | 5,620,000.00  | 0.68 |
| 38 | 605499 | 东鹏饮料 | 23,200    | 3,963,952.00  | 0.48 |
| 39 | 01024  | 快手-W | 50,000    | 3,737,180.30  | 0.45 |
| 40 | 600323 | 瀚蓝环境 | 180,000   | 3,690,000.00  | 0.45 |
| 41 | 600760 | 中航沈飞 | 60,000    | 3,627,000.00  | 0.44 |
| 42 | 300777 | 中简科技 | 67,000    | 3,229,400.00  | 0.39 |
| 43 | 600048 | 保利发展 | 161,900   | 2,826,774.00  | 0.34 |
| 44 | 601966 | 玲珑轮胎 | 100,000   | 2,537,000.00  | 0.31 |
| 45 | 002507 | 涪陵榨菜 | 65,000    | 2,243,800.00  | 0.27 |
| 46 | 002049 | 紫光国微 | 10,000    | 1,897,200.00  | 0.23 |
| 47 | 300395 | 菲利华  | 35,000    | 1,575,000.00  | 0.19 |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 48 | 688235 | 百济神州 | 14,653 | 1,455,482.49 | 0.18 |
| 49 | 600893 | 航发动力 | 31,200 | 1,419,912.00 | 0.17 |
| 50 | 002557 | 洽洽食品 | 17,441 | 992,916.13   | 0.12 |
| 51 | 603960 | 克来机电 | 33,940 | 697,467.00   | 0.08 |
| 52 | 688349 | 三一重能 | 15,019 | 612,024.25   | 0.07 |
| 53 | 688400 | 凌云光  | 13,111 | 287,524.23   | 0.03 |
| 54 | 688270 | 臻镭科技 | 3,705  | 221,818.35   | 0.03 |
| 55 | 301139 | 元道通信 | 5,651  | 217,337.46   | 0.03 |
| 56 | 301239 | 普瑞眼科 | 5,747  | 193,386.55   | 0.02 |
| 57 | 688259 | 创耀科技 | 1,595  | 126,355.90   | 0.02 |
| 58 | 688237 | 超卓航科 | 2,891  | 119,311.57   | 0.01 |
| 59 | 688150 | 莱特光电 | 5,626  | 110,269.60   | 0.01 |
| 60 | 301233 | 盛帮股份 | 1,576  | 65,435.52    | 0.01 |
| 61 | 301238 | 瑞泰新材 | 1,998  | 64,075.86    | 0.01 |
| 62 | 601089 | 福元医药 | 1,749  | 36,816.45    | 0.00 |
| 63 | 301217 | 铜冠铜箔 | 2,456  | 36,422.48    | 0.00 |
| 64 | 301236 | 软通动力 | 1,131  | 35,490.78    | 0.00 |
| 65 | 001323 | 慕思股份 | 573    | 28,111.38    | 0.00 |
| 66 | 301200 | 大族数控 | 532    | 27,621.44    | 0.00 |
| 67 | 301302 | 华如科技 | 466    | 26,291.72    | 0.00 |
| 68 | 301201 | 诚达药业 | 353    | 25,253.62    | 0.00 |
| 69 | 301216 | 万凯新材 | 784    | 23,394.56    | 0.00 |
| 70 | 301263 | 泰恩康  | 682    | 21,401.16    | 0.00 |
| 71 | 301207 | 华兰疫苗 | 356    | 20,085.52    | 0.00 |
| 72 | 301102 | 兆讯传媒 | 642    | 19,959.78    | 0.00 |
| 73 | 300834 | 星辉环材 | 635    | 19,069.05    | 0.00 |
| 74 | 301219 | 腾远钴业 | 209    | 18,354.38    | 0.00 |
| 75 | 301162 | 国能日新 | 334    | 18,072.74    | 0.00 |
| 76 | 301112 | 信邦智能 | 399    | 17,970.96    | 0.00 |
| 77 | 301153 | 中科江南 | 398    | 17,504.04    | 0.00 |
| 78 | 301123 | 奕东电子 | 656    | 16,655.84    | 0.00 |
| 79 | 301103 | 何氏眼科 | 507    | 16,234.14    | 0.00 |
| 80 | 301235 | 华康医疗 | 418    | 15,854.74    | 0.00 |
| 81 | 301286 | 侨源股份 | 784    | 15,515.36    | 0.00 |
| 82 | 301151 | 冠龙节能 | 703    | 15,086.38    | 0.00 |
| 83 | 301189 | 奥尼电子 | 435    | 14,489.85    | 0.00 |
| 84 | 301117 | 佳缘科技 | 262    | 14,263.28    | 0.00 |
| 85 | 301258 | 富士莱  | 295    | 12,295.60    | 0.00 |
| 86 | 301116 | 益客食品 | 577    | 11,805.42    | 0.00 |
| 87 | 001268 | 联合精密 | 409    | 11,337.48    | 0.00 |
| 88 | 301237 | 和顺科技 | 261    | 10,925.46    | 0.00 |
| 89 | 301137 | 哈焊华通 | 644    | 10,297.56    | 0.00 |

|    |        |      |     |           |      |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 90 | 301196 | 唯科科技 | 271 | 10,167.92 | 0.00 |
| 91 | 301222 | 浙江恒威 | 332 | 9,614.72  | 0.00 |
| 92 | 301125 | 腾亚精工 | 327 | 8,966.34  | 0.00 |
| 93 | 301130 | 西点药业 | 237 | 8,934.90  | 0.00 |
| 94 | 301135 | 瑞德智能 | 338 | 8,875.88  | 0.00 |
| 95 | 301110 | 青木股份 | 202 | 8,049.70  | 0.00 |
| 96 | 301181 | 标榜股份 | 257 | 7,861.63  | 0.00 |
| 97 | 301158 | 德石股份 | 379 | 7,724.02  | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600346 | 恒力石化 | 19,636,095.00 | 1.62           |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 16,147,820.00 | 1.33           |
| 3  | 600383 | 金地集团 | 15,510,229.00 | 1.28           |
| 4  | 603520 | 司太立  | 14,999,385.20 | 1.24           |
| 5  | 000739 | 普洛药业 | 14,626,746.24 | 1.20           |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 14,325,932.79 | 1.18           |
| 7  | 601899 | 紫金矿业 | 13,736,974.00 | 1.13           |
| 8  | 600309 | 万华化学 | 12,835,224.60 | 1.06           |
| 9  | 601985 | 中国核电 | 11,270,018.00 | 0.93           |
| 10 | 002493 | 荣盛石化 | 10,844,222.00 | 0.89           |
| 11 | 002508 | 老板电器 | 10,476,909.09 | 0.86           |
| 12 | 603517 | 绝味食品 | 8,381,938.00  | 0.69           |
| 13 | 603786 | 科博达  | 7,072,731.58  | 0.58           |
| 14 | 300699 | 光威复材 | 7,072,246.00  | 0.58           |
| 15 | 300760 | 迈瑞医疗 | 6,381,195.50  | 0.53           |
| 16 | 600521 | 华海药业 | 6,055,511.00  | 0.50           |
| 17 | 601966 | 玲珑轮胎 | 5,592,448.00  | 0.46           |
| 18 | 600862 | 中航高科 | 4,913,353.00  | 0.40           |
| 19 | 002706 | 良信股份 | 4,422,936.00  | 0.36           |
| 20 | 600176 | 中国巨石 | 3,952,953.36  | 0.33           |

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  | 002493 | 荣盛石化 | 57,804,088.50 | 4.76           |
| 2  | 601601 | 中国太保 | 38,982,464.50 | 3.21           |
| 3  | 600801 | 华新水泥 | 37,015,429.75 | 3.05           |
| 4  | 600905 | 三峡能源 | 36,790,716.00 | 3.03           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5  | 600585 | 海螺水泥 | 33,404,149.44 | 2.75 |
| 6  | 600989 | 宝丰能源 | 31,224,615.96 | 2.57 |
| 7  | 600346 | 恒力石化 | 29,708,485.98 | 2.45 |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 25,471,633.40 | 2.10 |
| 9  | 300258 | 精锻科技 | 22,405,654.51 | 1.85 |
| 10 | 002572 | 索菲亚  | 21,911,887.49 | 1.80 |
| 11 | 600887 | 伊利股份 | 19,530,013.70 | 1.61 |
| 12 | 600004 | 白云机场 | 17,544,927.00 | 1.45 |
| 13 | 600519 | 贵州茅台 | 15,968,061.75 | 1.32 |
| 14 | 002557 | 洽洽食品 | 12,451,329.29 | 1.03 |
| 15 | 001979 | 招商蛇口 | 10,846,165.84 | 0.89 |
| 16 | 002508 | 老板电器 | 9,708,165.00  | 0.80 |
| 17 | 600009 | 上海机场 | 9,521,557.50  | 0.78 |
| 18 | 003816 | 中国广核 | 9,025,448.00  | 0.74 |
| 19 | 601985 | 中国核电 | 7,850,335.00  | 0.65 |
| 20 | 603517 | 绝味食品 | 7,341,383.00  | 0.60 |

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 | 243,664,587.26 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 521,783,068.79 |

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：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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。

### 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 | 128,734.87   |
| 2  | 应收清算款 | 1,372,419.60 |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 5,111,077.30 |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 6,612,231.77 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构         |            |                |            |
|------------|-----------|------------|---------------|------------|----------------|------------|
|            |           |            | 机构投资者         |            | 个人投资者          |            |
|            |           |            | 持有份额          | 占总份额比例 (%) | 持有份额           | 占总份额比例 (%) |
| 德邦价值优选混合 A | 7,744     | 101,017.29 | 24,998,700.00 | 3.20       | 757,279,155.32 | 96.80      |
| 德邦价值优选混合 C | 1,928     | 17,670.59  | 0.00          | 0          | 34,068,890.33  | 100.00     |
| 合计         | 9,672     | 84,403.10  | 24,998,700.00 | 3.06       | 791,348,045.65 | 96.94      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 德邦价值优选混合 A | 545,212.66 | 0.0697       |
|                  | 德邦价值优选混合 C | 51,537.13  | 0.1513       |
|                  | 合计         | 596,749.79 | 0.0731       |

### 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 | 德邦价值优选混合 A | 10~50              |
|                                | 德邦价值优选混合 C | 0~10               |
|                                | 合计         | 10~50              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 德邦价值优选混合 A | 0~10               |
|                                | 德邦价值优选混合 C | 0                  |
|                                | 合计         | 0~10               |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 德邦价值优选混合 A | 德邦价值优选混合 C |
|----|------------|------------|
|----|------------|------------|

|  |                  |               |
|--|------------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2021 年 8 月 12 日)<br>基金份额总额 | 1,315,472,821.70 | 34,239,329.49 |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 1,154,450,163.49 | 27,389,356.77 |
| 本报告期基金总申购份额                            | 13,334,695.29    | 16,697,547.13 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                          | 385,507,003.46   | 10,018,013.57 |
| 本报告期基金拆分变动份额                           | -                | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 782,277,855.32   | 34,068,890.33 |

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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期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

本报告期内, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

|            | 数量 | 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 (%) |   |
|------------|----|----------------|------------------|------------|----------------|---|
| 广发证券       | 2  | 258,452,912.24 | 34.47            | 240,696.10 | 38.00          | - |
| 浙商证券股份有限公司 | 2  | 214,034,130.33 | 28.55            | 156,520.52 | 24.71          | - |
| 西藏东方财富证券   | 2  | 111,906,551.45 | 14.93            | 82,108.98  | 12.96          | - |
| 海通证券       | 2  | 104,379,295.40 | 13.92            | 97,209.18  | 15.35          | - |
| 国海证券       | 2  | 61,018,851.55  | 8.14             | 56,825.61  | 8.97           | - |
| 第一创业证券     | 2  | -              | -                | -          | -              | - |
| 东北证券       | 2  | -              | -                | -          | -              | - |
| 东方证券       | 2  | -              | -                | -          | -              | - |
| 国联证券       | 1  | -              | -                | -          | -              | - |
| 国泰君安证券     | 2  | -              | -                | -          | -              | - |
| 申万宏源证券     | 2  | -              | -                | -          | -              | - |
| 天风证券       | 2  | -              | -                | -          | -              | - |
| 西部证券       | 2  | -              | -                | -          | -              | - |
| 中金公司       | 2  | -              | -                | -          | -              | - |

注：1、公司选择基金专用交易席位的基本选择标准：

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

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

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

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

2、本报告期内, 本基金新增国海证券的交易单元、减少国联证券的交易单元。

### 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(%) |
| 广发证券       | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 浙商证券股份有限公司 | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 西藏东方财富证券   | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 海通证券       | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国海证券       | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 第一创业证券     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东北证券       | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 东方证券       | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国联证券       | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 国泰君安证券     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 申万宏源证券     | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 天风证券       | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 西部证券       | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 中金公司       | -    | -               | -      | -                 | -    | -               |

### 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公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022年1月4日 |
| 2  | 德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行费率优惠活动的公告      | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022年1月6日 |
| 3  | 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的公告    | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022年1月6日 |

|    |   |                |                 |
|----|---|----------------|-----------------|
| 4  | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富为代销机构、开通定期定额投资、转换业务并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 1 月 6 日  |
| 5  | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加德邦证券为销售机构并开通定期定额投资业务的公告             | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 1 月 12 日 |
| 6  | 德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加宁波银行同业易管家平台费率优惠活动的公告                  | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 1 月 13 日 |
| 7  | 德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加德邦证券费率优惠活动的公告                         | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 1 月 13 日 |
| 8  | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金参加第一创业证券股份有限公司费率优惠活动的公告               | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 1 月 20 日 |
| 9  | 德邦价值优选混合型证券投资基金 2021 年第四季度报告                            | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 1 月 21 日 |
| 10 | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构的公告                        | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 2 月 23 日 |
| 11 | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票及相关风险提示的公告       | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 2 月 25 日 |
| 12 | 德邦基金管理有限公司关于调整旗下基金在直销渠道开展相关业务费率优惠活动的公告                  | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 2 月 26 日 |
| 13 | 德邦价值优选混合型证券投资基金 2021 年年度报告                              | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 3 月 31 日 |
| 14 | 德邦基金管理有限公司关于旗下基金在安信证券调整申购、定期定额投资业务最低限额的公告               | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 4 月 11 日 |
| 15 | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金调整申购、定期定额投资业务最低限额的公告                  | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 4 月 14 日 |
| 16 | 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                        | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 4 月 19 日 |
| 17 | 德邦价值优选混合型证券投资基金 2022 年第一季度报告                            | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 18 | 德邦基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司销售本公司旗下基金的公告   | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 5 月 6 日  |
| 19 | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加攀赢基金为销售机构的公告                        | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 5 月 24 日 |

|    |  |                |                 |
|----|--|----------------|-----------------|
| 20 | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加平安银行为销售机构的公告                       | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 5 月 25 日 |
| 21 | 德邦基金管理有限公司关于德邦价值优选混合型证券投资基金增加中金财富证券为销售机构的公告            | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 5 月 26 日 |
| 22 | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加排排网基金为销售机构的公告                      | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 6 月 6 日  |
| 23 | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加农业银行为销售机构的公告                       | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 6 月 21 日 |
| 24 | 德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金在申万宏源证券及申万宏源西部证券调整申购、定期定额投资业务最低限额的公告 | 中国证监会规定网站及规定报刊 | 2022 年 6 月 22 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、德邦价值优选混合型证券投资基金基金合同；
- 3、德邦价值优选混合型证券投资基金托管协议；
- 4、德邦价值优选混合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。

### 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

2022 年 8 月 30 日