

德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF） 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：国泰君安证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰君安证券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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
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
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	42
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	43
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	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）	
基金简称	量化优选	
基金主代码	167702	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2017 年 3 月 24 日	
基金管理人	德邦基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	34,566,477.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
下属分级基金的场内简称	量化优选	优选 C
下属分级基金的交易代码	167702	167703
报告期末下属分级基金的份额总额	11,750,516.86 份	22,815,960.26 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求严格控制投资风险的前提下，通过数量化的方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过资股票投资策略、固定收益投资策略、衍生品投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券的投资策略、国债期货投资策略等多方面进行全面分析，调整投资组合配置。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		德邦基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张秀玉	胡凯
	联系电话	021-26010852	021-38037354
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	hukai@gtjas.com
客户服务电话		4008217788	021-38917599-5
传真		021-26010808	021-38677819
注册地址		上海市虹口区东大名路 501 号 503B 单元	中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址	上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元	上海市静安区新闻路 669 号博华 广场 19 楼
邮政编码	200010	200041
法定代表人	左畅	贺青

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§ 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)	
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
本期已实现收益	-1,453,809.28	-4,762,805.54
本期利润	-923,324.73	-2,995,613.38
加权平均基金份额 本期利润	-0.1097	-0.1054
本期加权平均净 值利润率	-8.57%	-8.43%
本期基金份额净 值增长率	-9.19%	-9.30%
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	4,147,398.12	7,339,126.49
期末可供分配基 金份额利润	0.3530	0.3217
期末基金资产净 值	15,897,914.98	30,155,086.75
期末基金份额净	1.3530	1.3217

值		
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	54.29%	51.07%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦量化优选股票 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	9.23%	1.00%	9.12%	1.02%	0.11%	-0.02%
过去三个月	6.53%	1.51%	5.93%	1.36%	0.60%	0.15%
过去六个月	-9.19%	1.54%	-8.72%	1.38%	-0.47%	0.16%
过去一年	-19.77%	1.47%	-13.40%	1.18%	-6.37%	0.29%
过去三年	30.42%	1.29%	16.70%	1.20%	13.72%	0.09%
自基金合同生效起至今	54.29%	1.24%	28.62%	1.18%	25.67%	0.06%

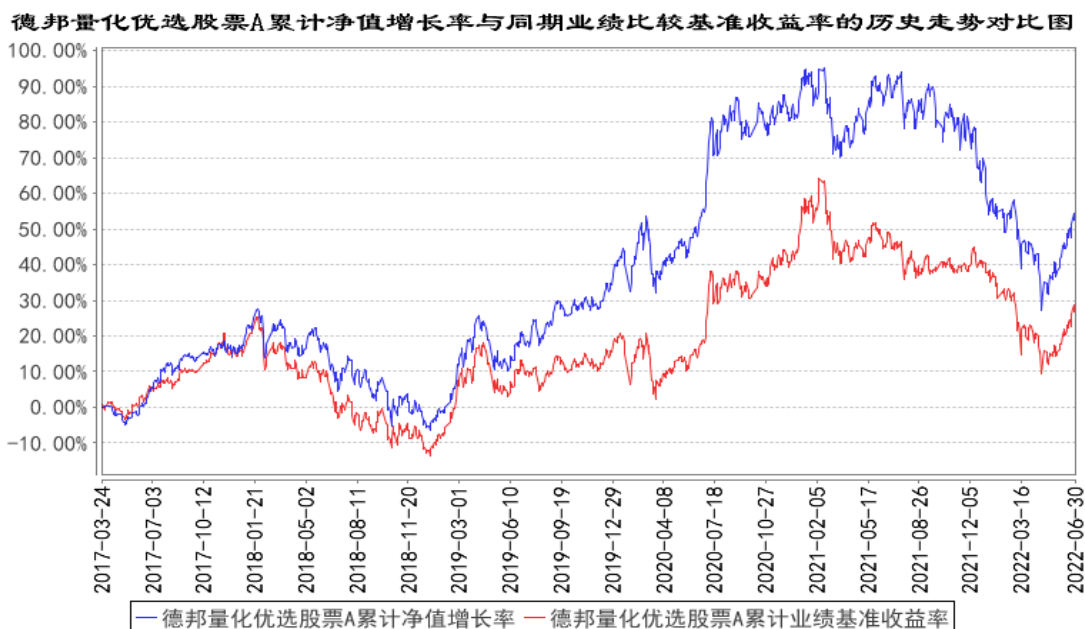
德邦量化优选股票 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

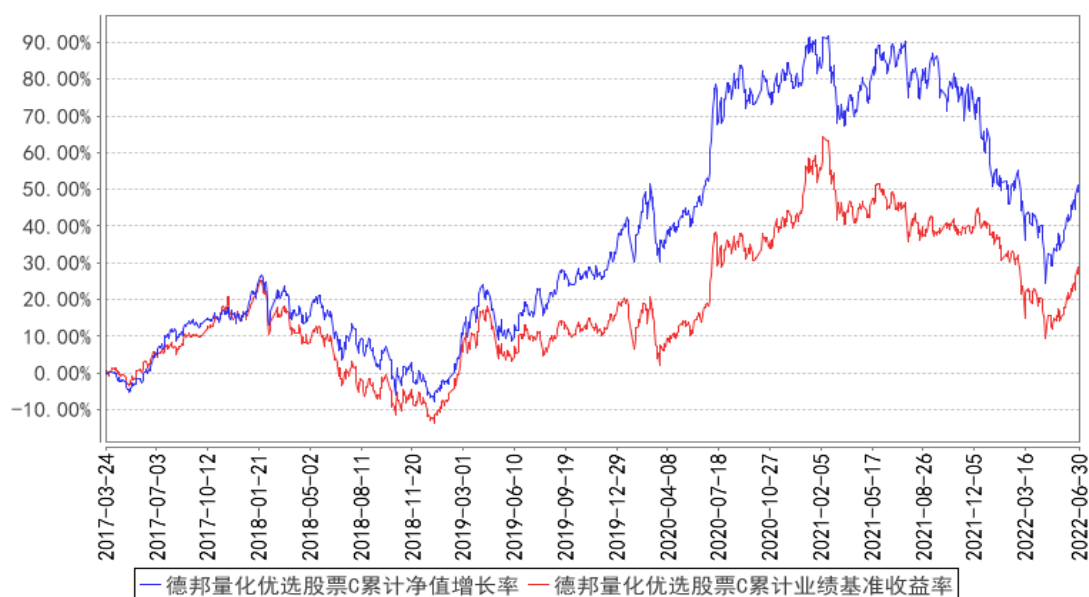
过去一个月	9.20%	0.99%	9.12%	1.02%	0.08%	-0.03%
过去三个月	6.46%	1.51%	5.93%	1.36%	0.53%	0.15%
过去六个月	-9.30%	1.54%	-8.72%	1.38%	-0.58%	0.16%
过去一年	-19.98%	1.47%	-13.40%	1.18%	-6.58%	0.29%
过去三年	29.48%	1.29%	16.70%	1.20%	12.78%	0.09%
自基金合同生效起 至今	51.07%	1.23%	28.62%	1.18%	22.45%	0.05%

注：本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率 (税后)}$

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



德邦量化优选股票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 2017 年 03 月 24 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2017 年 03 月 24 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		
吴志鹏	本基金的基金经理	2021 年 6 月 29 日	-	6 年	硕士，于 2016 年 4 月加入德邦基金管理有限公司，历任投资三部（量化）研究员，专户投资部投资经理，量化投资部研究员。现任德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦民裕进取量化精选灵活配置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、德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金的基金经理。
李荣兴	本基金的基金经理	2022 年 6 月 17 日	-	11 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，现任德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

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

回顾 2022 年上半年，市场在俄乌冲突，上海疫情，市场自身去杠杆等一系列内忧外患事件的共同作用下，上证指数一度跌破 3000 点的整数心理大关。但好在流动性非常充裕，市场在跌到某个平衡点之后就开启了报复性反弹。小市值的板块在杠杆出清之后，表现出极强的韧性，成为本轮反弹的“领头羊”。

在投资管理上，本基金坚持采取量化策略进行投资管理与风险控制，通过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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末德邦量化优选股票 A 基金份额净值为 1.3530 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.19%；截至本报告期末德邦量化优选股票 C 基金份额净值为 1.3217 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.30%；同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，虽然政治局会议中不再明确的提到全年 5.5% 的经济增速，但确强调“力争实现最好结果”。这样的表述说明我们下半年并不会“躺平”，而且要“尽快形成实物工作量”，稳增长依然是重中之重。从沥青开工率，螺纹钢价格等基建相关指标来看，近期都有明显的回升，下半年基建或许会有不错的表现。从周期模型的角度来看，下半年临近年底的时候基钦周期即将见底回升，将会与处于上行周期末端的朱格拉周期形成共振（一轮朱格拉周期的上行能够嵌套两轮基钦周期），上一次共振的时候发生在 17 年前，历史规律上看，两个对资本市场影响最大的两个周期共振向上的时候，市场表现一般都不会太差。

从估值的角度来看，当前沪深 300 指数市盈率 12 倍左右，低于历史均值，位于历史中位数附近，仍然具有一定的性价比。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《德邦基金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历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

告期末，本基金基金资产净值已恢复至五千万元以上。

§ 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	2,535,664.01	3,116,826.38
结算备付金		1,495,697.12	422,189.01
存出保证金		486,652.58	67,938.53
交易性金融资产	6.4.7.2	37,694,420.10	41,553,982.08
其中：股票投资		37,388,705.31	41,553,982.08
基金投资		—	—
债券投资		305,714.79	—
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		785,882.05	85,276.78
应收股利		-	-
应收申购款		5,011,682.40	3,778.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,977.00
资产总计		48,009,998.26	45,251,968.00
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,322,790.26	391,038.72
应付赎回款		2,191.54	498.73
应付管理人报酬		39,177.28	41,237.13
应付托管费		7,835.43	8,247.43
应付销售服务费		7,633.48	8,063.77
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	577,368.54	295,679.89
负债合计		1,956,996.53	744,765.67
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	34,566,477.12	30,384,048.02
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	11,486,524.61	14,123,154.31
净资产合计		46,053,001.73	44,507,202.33
负债和净资产总计		48,009,998.26	45,251,968.00

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，德邦量化优选股票 A 基金份额净值 1.3530 元，基金份额总额 11,750,516.86 份；德邦量化优选股票 C 基金份额净值 1.3217 元，基金份额总额 22,815,960.26 份。量化优选份额总额合计 34,566,477.12 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：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-3,529,778.78	4,462,000.56
1. 利息收入		45,059.27	38,751.95
其中：存款利息收入	6.4.7.13	45,059.27	38,749.06
债券利息收入		-	2.89
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）		-5,886,330.67	6,873,637.90
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-6,031,107.20	6,583,843.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	766.82	9,071.71
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-242,819.99	-
股利收益	6.4.7.19	386,829.70	280,722.38
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,297,676.71	-2,472,979.41
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	13,815.91	22,590.12
减：二、营业总支出		389,159.33	1,103,672.94

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	229,703.27	248,714.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,940.64	49,742.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	44,091.06	49,121.69
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	69,424.36	756,093.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,918,938.11	3,358,327.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,918,938.11	3,358,327.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,918,938.11	3,358,327.62

注：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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

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 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)	30,384,048.02	-	14,123,154.31	44,507,202.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本 期 初 净 资 产(基 金 净 值)	30,384,048.02	-	14,123,154.31	44,507,202.33
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少 以“-” 号 填 列)	4,182,429.10	-	-2,636,629.70	1,545,799.40
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-3,918,938.11	-3,918,938.11
(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)	4,182,429.10	-	1,282,308.41	5,464,737.51
其中:1. 基 金 申 购 款	18,881,157.93	-	5,184,636.25	24,065,794.18
2 . 基 金 赎 回 款	-14,698,728.83	-	-3,902,327.84	-18,601,056.67
(三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基 金 净 值 变 动(净 值 减 少 以“-” 号 填 列)	-	-	-	-
(四)、 其 他 综 合 收 益 结 转 留	-	-	-	-

存收益				
四、本期期末净资产(基金净值)	34,566,477.12	-	11,486,524.61	46,053,001.73
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	65,045,544.97	-	39,456,244.41	104,501,789.38
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)	65,045,544.97	-	39,456,244.41	104,501,789.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-41,285,670.92	-	-23,790,887.28	-65,076,558.20
(一)、综合收益总额	-	-	3,358,327.62	3,358,327.62
(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)	-41,285,670.92	-	-27,149,214.90	-68,434,885.82
其中:1.	7,795,168.64	-	4,699,633.35	12,494,801.99

基金申购款				
2. 基金赎回款	-49,080,839.56	-	-31,848,848.25	-80,929,687.81
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	23,759,874.05	-	15,665,357.13	39,425,231.18

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：

张騅

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

德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（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[2016]1708 号文《关于准予德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由基金管理人德邦基金管理有限公司向社会公开募集。基金合同于 2017 年 3 月 24 日生效。首次设立时募集规模为 201,030,406.44 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为德邦基金管理有限公司，注册登记机构

为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

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（含存托凭证）、债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 80%；扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率 (税后)}$

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》的规定和相关法律法规的要求，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 3,116,826.38 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,734.34 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，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 3,118,560.72 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 422,189.01 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 209.00 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 422,398.01 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 67,938.53 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 33.66 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 67,972.19 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 1,977.00 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 1,734.34 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 209.00 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 33.66 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,535,664.01
等于：本金	2,533,926.64
加：应计利息	1,737.37
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,535,664.01

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	36,134,432.29	-	37,388,705.31	1,254,273.02
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	300,150.00	5,654.79	305,714.79	-90.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	300,150.00	5,654.79	305,714.79	-90.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		36,434,582.29	5,654.79	37,694,420.10	1,254,183.02

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	2,582,200.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,582,200.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,582,200.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	2.00	2,573,840.00	-8,360.00
合计				-8,360.00
减：可抵销期货暂收款				-8,360.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末不存在按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

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

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

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

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	7.93
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	347,936.25
其中：交易所市场	347,936.25
银行间市场	—
应付利息	—
应付审计费	69,752.78
应付信息披露费	159,671.58

合计	577,368.54
----	------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

德邦量化优选股票 A

项目	本期 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	6,973,985.45	6,973,985.45
本期申购	7,093,549.96	7,093,549.96
本期赎回（以“-”号填列）	-2,317,018.55	-2,317,018.55
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	11,750,516.86	11,750,516.86

德邦量化优选股票 C

项目	本期 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	23,410,062.57	23,410,062.57
本期申购	11,787,607.97	11,787,607.97
本期赎回（以“-”号填列）	-12,381,710.28	-12,381,710.28
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	22,815,960.26	22,815,960.26

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

德邦量化优选股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,267,999.72	-1,851,055.55	3,416,944.17
本期利润	-1,453,809.28	530,484.55	-923,324.73
本期基金份额交易产生的变动数	2,929,880.28	-1,276,101.60	1,653,778.68
其中：基金申购款	4,144,435.08	-1,906,407.62	2,238,027.46
基金赎回款	-1,214,554.80	630,306.02	-584,248.78
本期已分配利润	-	-	-

本期末	6,744,070.72	-2,596,672.60	4,147,398.12
-----	--------------	---------------	--------------

德邦量化优选股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	16,792,659.17	-6,086,449.03	10,706,210.14
本期利润	-4,762,805.54	1,767,192.16	-2,995,613.38
本期基金份额交易产生的变动数	251,304.01	-622,774.28	-371,470.27
其中：基金申购款	6,618,668.97	-3,672,060.18	2,946,608.79
基金赎回款	-6,367,364.96	3,049,285.90	-3,318,079.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,281,157.64	-4,942,031.15	7,339,126.49

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	39,640.56
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	4,713.86
其他	704.85
合计	45,059.27

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	-6,031,107.20
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	-6,031,107.20

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	302,134,758.61
减：卖出股票成本总额	307,285,344.75
减：交易费用	880,521.06
买卖股票差价收入	-6,031,107.20

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	767.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-0.30
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	766.82

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	0.30
买卖债券差价收入	-0.30

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益赎回差价收入。

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-242,819.99

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	386,829.70
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	386,829.70

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,306,036.71
股票投资	2,306,126.71
债券投资	-90.00
资产支持证券投资	-

基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-8,360.00
权证投资	-
期货投资	-8,360.00
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	2,297,676.71

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,815.91
合计	13,815.91

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	69,424.36

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、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”）	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
德邦创新资本有限责任公司（“德邦创新”）	基金管理人的子公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
德邦证券	-	-	-	-
国泰君安	248,924,021.74	41.28	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国泰君安	231,822.98	43.98	125,415.60	36.05
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国泰君安	-	-	-	-

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	229,703.27	248,714.82
其中：支付销售机构的客户维护费	19,935.47	22,141.36

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提。其计算公式为：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,940.64	49,742.96

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提。其计算公式为：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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		
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C	合计
德邦基金	—	32,275.97	32,275.97
德邦证券	—	83.00	83.00
国泰君安	—	5.43	5.43
合计	—	32,364.40	32,364.40
获得销售服务费的各关联	上年度可比期间		

方名称	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C	合计
德邦基金	—	47,729.78	47,729.78
德邦证券	—	72.92	72.92
国泰君安	—	12.23	12.23
合计	—	47,814.93	47,814.93

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	0.00	—
报告期间申购/买入总份额	1,558,223.16	—

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	1,558,223.16	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.5100%	-
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

份额单位：份

德邦量化优选股票 C

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
德邦创新	16,221,243.47	71.1000	16,221,243.47	69.2900

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		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安	2,535,664.01	39,640.56	2,680,354.53	35,281.48

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未发生其它关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(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

注：本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同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；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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	305,714.79	-
合计	305,714.79	-

注：未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债及超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,535,664.01	-	-	-	-	-	2,535,664.01
结算备付金	1,495,697.12	-	-	-	-	-	1,495,697.12
存出保证金	-	-	-	-	-	486,652.58	486,652.58
交易性金融资产	305,714.79	-	-	-	-	37,388,705.31	37,694,420.10
应收申购款	-	-	-	-	-	5,011,682.40	5,011,682.40
应收清算款	-	-	-	-	-	785,882.05	785,882.05
资产总计	4,337,075.92	-	-	-	-	43,672,922.34	48,009,998.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,191.54	2,191.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	39,177.28	39,177.28
应付托管费	-	-	-	-	-	7,835.43	7,835.43
应付清算款	-	-	-	-	-	1,322,790.26	1,322,790.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,633.48	7,633.48
其他负债	-	-	-	-	-	577,368.54	577,368.54
负债总计	-	-	-	-	-	1,956,996.53	1,956,996.53
利率敏感度缺口	4,337,075.92	-	-	-	-	41,715,925.81	46,053,001.73
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,116,826.38	-	-	-	-	-	3,116,826.38
结算备付金	422,189.01	-	-	-	-	-	422,189.01
存出保证金	67,938.53	-	-	-	-	-	67,938.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	41,553,982.08	41,553,982.08
应收证券清算款	-	-	-	-	-	85,276.78	85,276.78
应收申购款	-	-	-	-	-	3,778.22	3,778.22
其他资产	-	-	-	-	-	1,977.00	1,977.00
资产总计	3,606,953.92	-	-	-	-	41,645,014.08	45,251,968.00
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	391,038.72	391,038.72
应付赎回款	-	-	-	-	-	498.73	498.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,237.13	41,237.13
应付托管费	-	-	-	-	-	8,247.43	8,247.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,063.77	8,063.77
其他负债	-	-	-	-	-	295,679.89	295,679.89

负债总计	-	-	-	-	-	744,765.67	744,765.67
利率敏感度缺口	3,606,953.92	-	-	-	-	40,900,248.41	44,507,202.33

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值比例为 0.66%（2021 年 12 月 31 日：未持有），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。

6.4.13.4.3 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的股票，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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	37,388,705.31	81.19	41,553,982.08	93.36
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	305,714.79	0.66	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	37,694,420.10	81.85	41,553,982.08	93.36

注：本基金的投资组合比例为：基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 80%；扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上表所示。

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%	412,788.79	382,856.41
	沪深 300 下降 1%	-412,788.79	-382,856.41

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。下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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	37,388,705.31	41,553,982.08

第二层次	305,714.79	—
第三层次	—	—
合计	37,694,420.10	41,553,982.08

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、境内股票涨跌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	37,388,705.31	77.88
	其中：股票	37,388,705.31	77.88
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	305,714.79	0.64
	其中：债券	305,714.79	0.64
	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	4,031,361.13	8.40
8	其他各项资产	6,284,217.03	13.09
9	合计	48,009,998.26	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	99,486.00	0.22
B	采矿业	1,114,273.00	2.42
C	制造业	22,115,326.31	48.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,254,301.00	2.72
E	建筑业	777,828.00	1.69
F	批发和零售业	175,734.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	1,325,182.00	2.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,928,139.00	4.19
J	金融业	6,728,451.00	14.61
K	房地产业	903,277.00	1.96
L	租赁和商务服务业	212,504.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	592,693.00	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	92,276.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	69,235.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,388,705.31	81.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	34,500	1,455,900.00	3.16
2	600519	贵州茅台	700	1,431,500.00	3.11
3	601318	中国平安	25,100	1,171,919.00	2.54
4	000725	京东方 A	286,500	1,128,810.00	2.45
5	000858	五粮液	5,500	1,110,615.00	2.41
6	002460	赣锋锂业	7,200	1,070,640.00	2.32
7	600438	通威股份	17,600	1,053,536.00	2.29
8	600089	特变电工	35,800	980,562.00	2.13

9	688561	奇安信	17,400	970,920.00	2.11
10	002821	凯莱英	3,300	953,700.00	2.07
11	000333	美的集团	15,289	923,302.71	2.00
12	601288	农业银行	278,300	840,466.00	1.82
13	601988	中国银行	254,500	829,670.00	1.80
14	002594	比亚迪	2,400	800,376.00	1.74
15	600900	长江电力	32,700	756,024.00	1.64
16	300760	迈瑞医疗	2,400	751,680.00	1.63
17	601162	天风证券	229,200	728,856.00	1.58
18	002129	TCL 中环	11,700	689,013.00	1.50
19	001979	招商蛇口	48,900	656,727.00	1.43
20	601618	中国中冶	179,900	629,650.00	1.37
21	000100	TCL 科技	129,100	618,389.00	1.34
22	603259	药明康德	5,500	571,945.00	1.24
23	002311	海大集团	9,200	552,092.00	1.20
24	000596	古井贡酒	2,200	549,252.00	1.19
25	601919	中远海控	37,700	524,030.00	1.14
26	600018	上港集团	82,100	478,643.00	1.04
27	300433	蓝思科技	42,800	473,796.00	1.03
28	601698	中国卫通	41,700	471,627.00	1.02
29	601857	中国石油	88,700	470,110.00	1.02
30	000157	中联重科	66,900	412,104.00	0.89
31	002841	视源股份	5,300	399,196.00	0.87
32	600426	华鲁恒升	13,400	391,280.00	0.85
33	600030	中信证券	18,000	389,880.00	0.85
34	601088	中国神华	11,300	376,290.00	0.82
35	601985	中国核电	51,800	355,348.00	0.77
36	600809	山西汾酒	1,000	324,800.00	0.71
37	300750	宁德时代	600	320,400.00	0.70
38	300628	亿联网络	4,100	312,215.00	0.68
39	601398	工商银行	64,900	309,573.00	0.67
40	600143	金发科技	32,400	308,448.00	0.67
41	600019	宝钢股份	47,700	287,154.00	0.62
42	601336	新华保险	7,700	247,863.00	0.54
43	600309	万华化学	2,200	213,378.00	0.46
44	002027	分众传媒	28,800	193,824.00	0.42
45	600585	海螺水泥	4,700	165,816.00	0.36
46	603658	安图生物	3,200	156,448.00	0.34
47	002271	东方雨虹	2,800	144,116.00	0.31
48	000338	潍柴动力	11,000	137,170.00	0.30
49	002885	京泉华	4,500	136,260.00	0.30
50	002125	湘潭电化	7,900	134,616.00	0.29

51	688036	传音控股	1,500	133,845.00	0.29
52	600499	科达制造	6,300	130,032.00	0.28
53	600104	上汽集团	7,200	128,232.00	0.28
54	002064	华峰化学	12,800	108,032.00	0.23
55	002748	世龙实业	7,300	107,967.00	0.23
56	002291	星期六	5,300	104,728.00	0.23
57	002738	中矿资源	1,100	101,871.00	0.22
58	300072	海新能科	20,000	101,200.00	0.22
59	688027	国盾量子	1,000	101,000.00	0.22
60	300829	金丹科技	3,100	100,502.00	0.22
61	603638	艾迪精密	4,900	100,450.00	0.22
62	002714	牧原股份	1,800	99,486.00	0.22
63	601717	郑煤机	6,900	99,429.00	0.22
64	002919	名臣健康	5,000	99,050.00	0.22
65	603229	奥翔药业	2,600	98,956.00	0.21
66	301035	润丰股份	1,200	98,940.00	0.21
67	300268	佳沃食品	3,300	98,175.00	0.21
68	603668	天马科技	4,700	96,303.00	0.21
69	688009	中国通号	21,200	96,036.00	0.21
70	688091	上海谊众	600	95,640.00	0.21
71	600893	航发动力	2,100	95,571.00	0.21
72	603908	牧高笛	1,000	95,150.00	0.21
73	603535	嘉诚国际	3,100	94,519.00	0.21
74	688339	亿华通	960	94,444.80	0.21
75	603978	深圳新星	4,400	93,764.00	0.20
76	300636	同和药业	3,900	93,600.00	0.20
77	000576	甘化科工	8,600	93,310.00	0.20
78	002142	宁波银行	2,600	93,106.00	0.20
79	000913	钱江摩托	5,300	93,068.00	0.20
80	002214	大立科技	7,300	92,856.00	0.20
81	688613	奥精医疗	3,000	92,820.00	0.20
82	601688	华泰证券	6,500	92,300.00	0.20
83	000803	北清环能	5,900	92,276.00	0.20
84	603138	海量数据	6,700	92,259.00	0.20
85	300225	金力泰	12,600	92,232.00	0.20
86	601099	太平洋	30,800	92,092.00	0.20
87	601901	方正证券	13,700	91,927.00	0.20
88	000617	中油资本	19,100	91,871.00	0.20
89	300271	华宇软件	12,200	91,744.00	0.20
90	601169	北京银行	20,200	91,708.00	0.20
91	601229	上海银行	14,000	91,700.00	0.20
92	000720	新能泰山	16,700	91,516.00	0.20

93	600028	中国石化	22,400	91,392.00	0.20
94	600595	中孚实业	22,800	90,972.00	0.20
95	000552	靖远煤电	21,100	90,941.00	0.20
96	000768	中航西飞	3,000	90,870.00	0.20
97	600792	云煤能源	22,400	90,720.00	0.20
98	603676	卫信康	9,000	90,720.00	0.20
99	300518	盛讯达	1,500	90,660.00	0.20
100	688076	诺泰生物	3,500	90,580.00	0.20
101	002352	顺丰控股	1,600	89,296.00	0.19
102	300536	农尚环境	5,200	88,140.00	0.19
103	002779	中坚科技	3,400	86,156.00	0.19
104	000002	万科 A	4,200	86,100.00	0.19
105	688788	科思科技	1,900	85,899.00	0.19
106	601619	嘉泽新能	20,900	85,690.00	0.19
107	600123	兰花科创	5,200	85,540.00	0.19
108	600035	楚天高速	26,100	85,347.00	0.19
109	002561	徐家汇	7,300	84,388.00	0.18
110	600219	南山铝业	22,800	84,132.00	0.18
111	688468	科美诊断	6,700	82,611.00	0.18
112	300769	德方纳米	200	81,736.00	0.18
113	600999	招商证券	5,400	77,814.00	0.17
114	688519	南亚新材	2,700	76,491.00	0.17
115	002466	天齐锂业	600	74,880.00	0.16
116	300179	四方达	4,700	73,696.00	0.16
117	002149	西部材料	5,300	72,080.00	0.16
118	600436	片仔癀	200	71,346.00	0.15
119	688200	华峰测控	200	71,280.00	0.15
120	300143	盈康生命	6,100	69,235.00	0.15
121	002824	和胜股份	1,200	65,988.00	0.14
122	688699	明微电子	600	65,076.00	0.14
123	000503	国新健康	7,000	62,860.00	0.14
124	601138	工业富联	6,100	60,024.00	0.13
125	600905	三峡能源	9,100	57,239.00	0.12
126	300672	国科微	700	57,232.00	0.12
127	600785	新华百货	4,100	52,398.00	0.11
128	300080	易成新能	10,400	52,208.00	0.11
129	600383	金地集团	3,700	49,728.00	0.11
130	000786	北新建材	1,400	48,468.00	0.11
131	600276	恒瑞医药	1,300	48,217.00	0.10
132	688357	建龙微纳	400	44,976.00	0.10
133	688390	固德威	140	43,821.40	0.10
134	600523	贵航股份	1,800	42,300.00	0.09

135	603369	今世缘	800	40,800.00	0.09
136	688798	艾为电子	300	40,764.00	0.09
137	603098	森特股份	1,100	39,446.00	0.09
138	601933	永辉超市	9,100	38,948.00	0.08
139	300142	沃森生物	800	38,712.00	0.08
140	300441	鲍斯股份	5,600	37,800.00	0.08
141	600033	福建高速	13,100	36,287.00	0.08
142	300659	中孚信息	1,600	34,032.00	0.07
143	300601	康泰生物	720	32,529.60	0.07
144	300138	晨光生物	2,000	31,140.00	0.07
145	300682	朗新科技	1,200	30,228.00	0.07
146	000629	攀钢钒钛	7,800	29,640.00	0.06
147	300134	大富科技	3,500	28,525.00	0.06
148	002082	万邦德	2,700	26,784.00	0.06
149	688356	键凯科技	100	24,181.00	0.05
150	688222	成都先导	1,300	20,748.00	0.05
151	300055	万邦达	2,200	20,592.00	0.04
152	600022	山东钢铁	11,500	20,010.00	0.04
153	600048	保利发展	1,100	19,206.00	0.04
154	002379	宏创控股	5,100	19,125.00	0.04
155	300578	会畅通讯	1,100	18,733.00	0.04
156	603648	畅联股份	2,000	18,680.00	0.04
157	600760	中航沈飞	300	18,135.00	0.04
158	603288	海天味业	200	18,072.00	0.04
159	300618	寒锐钴业	300	17,376.00	0.04
160	688198	佰仁医疗	140	17,068.80	0.04
161	002120	韵达股份	1,000	17,060.00	0.04
162	000738	航发控制	600	16,860.00	0.04
163	002807	江阴银行	3,600	16,308.00	0.04
164	002500	山西证券	2,700	15,498.00	0.03
165	000778	新兴铸管	2,600	12,532.00	0.03

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	300750	宁德时代	4,370,282.00	9.82
2	600585	海螺水泥	3,690,150.00	8.29
3	000858	五粮液	3,473,271.00	7.80
4	601318	中国平安	3,339,679.00	7.50
5	600519	贵州茅台	3,004,939.00	6.75
6	300274	阳光电源	2,876,821.00	6.46

7	600036	招商银行	2,862,521.00	6.43
8	601186	中国铁建	2,827,919.00	6.35
9	300595	欧普康视	2,769,042.00	6.22
10	300142	沃森生物	2,716,749.00	6.10
11	603260	合盛硅业	2,645,947.00	5.94
12	001289	龙源电力	2,644,120.76	5.94
13	000333	美的集团	2,640,916.02	5.93
14	002241	歌尔股份	2,623,450.00	5.89
15	688599	天合光能	2,597,842.91	5.84
16	002475	立讯精密	2,556,850.00	5.74
17	300122	智飞生物	2,519,035.00	5.66
18	603501	韦尔股份	2,395,976.00	5.38
19	002709	天赐材料	2,283,026.00	5.13
20	002821	凯莱英	2,280,136.00	5.12
21	000977	浪潮信息	2,268,112.00	5.10
22	600900	长江电力	2,259,095.00	5.08
23	300465	高伟达	2,192,031.00	4.93
24	000792	盐湖股份	2,176,608.00	4.89
25	688036	传音控股	2,154,870.28	4.84
26	601985	中国核电	2,141,902.00	4.81
27	000625	长安汽车	2,140,353.00	4.81
28	300769	德方纳米	2,124,211.00	4.77
29	601600	中国铝业	2,117,132.59	4.76
30	601800	中国交建	2,096,722.00	4.71
31	000100	TCL 科技	2,082,784.00	4.68
32	300601	康泰生物	2,053,920.00	4.61
33	601988	中国银行	2,024,566.00	4.55
34	601618	中国中冶	2,020,478.00	4.54
35	000725	京东方 A	1,962,644.00	4.41
36	300782	卓胜微	1,917,345.00	4.31
37	688561	奇安信	1,893,410.71	4.25
38	600309	万华化学	1,889,790.00	4.25
39	601288	农业银行	1,868,054.00	4.20
40	300059	东方财富	1,856,910.80	4.17
41	000768	中航西飞	1,855,699.00	4.17
42	601169	北京银行	1,821,617.00	4.09
43	300760	迈瑞医疗	1,819,264.00	4.09
44	600089	特变电工	1,815,578.00	4.08
45	688111	金山办公	1,795,057.71	4.03
46	600018	上港集团	1,791,674.00	4.03
47	000338	潍柴动力	1,763,574.00	3.96
48	601336	新华保险	1,747,830.00	3.93

49	603993	洛阳钼业	1,722,415.00	3.87
50	601633	长城汽车	1,699,484.00	3.82
51	002460	赣锋锂业	1,692,105.00	3.80
52	600745	闻泰科技	1,659,159.00	3.73
53	002594	比亚迪	1,650,377.00	3.71
54	300035	中科电气	1,611,461.00	3.62
55	002837	英维克	1,554,903.00	3.49
56	600763	通策医疗	1,537,763.00	3.46
57	002371	北方华创	1,537,185.00	3.45
58	601668	中国建筑	1,483,547.00	3.33
59	600111	北方稀土	1,468,177.00	3.30
60	600031	三一重工	1,438,292.00	3.23
61	601888	中国中免	1,417,543.00	3.18
62	603799	华友钴业	1,411,773.00	3.17
63	002008	大族激光	1,403,452.50	3.15
64	601919	中远海控	1,383,558.80	3.11
65	001979	招商蛇口	1,381,361.00	3.10
66	601966	玲珑轮胎	1,372,983.50	3.08
67	600011	华能国际	1,368,939.00	3.08
68	002791	坚朗五金	1,366,477.00	3.07
69	002233	塔牌集团	1,339,400.00	3.01
70	601390	中国中铁	1,335,429.00	3.00
71	601398	工商银行	1,321,135.00	2.97
72	300450	先导智能	1,320,022.00	2.97
73	002271	东方雨虹	1,314,707.00	2.95
74	600029	南方航空	1,306,528.00	2.94
75	002707	众信旅游	1,286,804.00	2.89
76	000069	华侨城 A	1,282,635.00	2.88
77	000157	中联重科	1,282,216.00	2.88
78	002714	牧原股份	1,258,826.00	2.83
79	002202	金风科技	1,248,149.00	2.80
80	601012	隆基绿能	1,247,319.00	2.80
81	603259	药明康德	1,232,728.00	2.77
82	002044	美年健康	1,216,539.00	2.73
83	300772	运达股份	1,214,725.00	2.73
84	601162	天风证券	1,213,472.00	2.73
85	002324	普利特	1,194,644.00	2.68
86	601111	中国国航	1,183,266.00	2.66
87	601166	兴业银行	1,182,646.00	2.66
88	600848	上海临港	1,180,320.00	2.65
89	601799	星宇股份	1,168,977.00	2.63
90	300014	亿纬锂能	1,160,340.00	2.61

91	603392	万泰生物	1,152,040.00	2.59
92	002841	视源股份	1,120,468.00	2.52
93	601100	恒立液压	1,113,877.00	2.50
94	000800	一汽解放	1,097,513.00	2.47
95	000807	云铝股份	1,093,875.00	2.46
96	688408	中信博	1,085,063.22	2.44
97	002179	中航光电	1,082,501.00	2.43
98	601857	中国石油	1,064,092.00	2.39
99	600276	恒瑞医药	1,051,062.00	2.36
100	600009	上海机场	1,037,081.00	2.33
101	600438	通威股份	1,032,405.00	2.32
102	002459	晶澳科技	1,026,150.00	2.31
103	002466	天齐锂业	1,022,977.00	2.30
104	300498	温氏股份	1,017,200.60	2.29
105	600801	华新水泥	1,006,251.00	2.26
106	601877	正泰电器	985,181.00	2.21
107	600570	恒生电子	969,311.00	2.18
108	600606	绿地控股	967,545.00	2.17
109	600999	招商证券	956,147.00	2.15
110	002415	海康威视	907,550.00	2.04
111	600271	航天信息	897,113.00	2.02
112	600436	片仔癀	896,741.00	2.01
113	600197	伊力特	896,079.00	2.01
114	600406	国电南瑞	892,911.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	6,534,694.00	14.68
2	300274	阳光电源	4,559,613.00	10.24
3	600585	海螺水泥	3,489,736.00	7.84
4	688599	天合光能	3,351,161.83	7.53
5	600519	贵州茅台	3,115,150.00	7.00
6	002459	晶澳科技	3,110,073.00	6.99
7	300035	中科电气	3,087,770.00	6.94
8	300595	欧普康视	2,839,693.70	6.38
9	601186	中国铁建	2,800,122.00	6.29
10	002241	歌尔股份	2,773,450.00	6.23
11	000858	五粮液	2,766,912.00	6.22
12	300142	沃森生物	2,746,077.00	6.17
13	001289	龙源电力	2,683,613.00	6.03

14	002709	天赐材料	2,604,453.00	5.85
15	603260	合盛硅业	2,564,824.00	5.76
16	603501	韦尔股份	2,546,813.38	5.72
17	002475	立讯精密	2,533,411.00	5.69
18	300122	智飞生物	2,506,952.00	5.63
19	600905	三峡能源	2,368,767.00	5.32
20	603606	东方电缆	2,330,259.00	5.24
21	002371	北方华创	2,269,170.23	5.10
22	000625	长安汽车	2,251,988.80	5.06
23	300465	高伟达	2,241,239.00	5.04
24	600111	北方稀土	2,226,792.00	5.00
25	601800	中国交建	2,159,029.00	4.85
26	000792	盐湖股份	2,152,281.00	4.84
27	601318	中国平安	2,126,818.00	4.78
28	300014	亿纬锂能	2,111,065.00	4.74
29	000977	浪潮信息	2,106,492.00	4.73
30	300769	德方纳米	2,081,539.00	4.68
31	601600	中国铝业	2,060,105.00	4.63
32	688036	传音控股	1,978,906.37	4.45
33	002466	天齐锂业	1,954,739.00	4.39
34	300782	卓胜微	1,930,859.00	4.34
35	300059	东方财富	1,862,486.60	4.18
36	300601	康泰生物	1,857,696.00	4.17
37	601985	中国核电	1,822,494.00	4.09
38	603993	洛阳钼业	1,798,480.00	4.04
39	000338	潍柴动力	1,787,240.00	4.02
40	002531	天顺风能	1,782,889.00	4.01
41	601012	隆基绿能	1,770,334.00	3.98
42	688111	金山办公	1,757,990.01	3.95
43	601633	长城汽车	1,739,472.00	3.91
44	000333	美的集团	1,726,532.00	3.88
45	601169	北京银行	1,674,165.12	3.76
46	000768	中航西飞	1,640,096.00	3.69
47	600309	万华化学	1,607,538.00	3.61
48	300850	新强联	1,601,235.00	3.60
49	600745	闻泰科技	1,538,033.00	3.46
50	601668	中国建筑	1,537,398.00	3.45
51	002791	坚朗五金	1,531,366.00	3.44
52	600900	长江电力	1,519,292.00	3.41
53	600036	招商银行	1,509,654.00	3.39
54	000100	TCL 科技	1,486,619.00	3.34
55	600763	通策医疗	1,464,632.00	3.29

56	600406	国电南瑞	1,448,454.00	3.25
57	601966	玲珑轮胎	1,444,141.00	3.24
58	002837	英维克	1,438,302.00	3.23
59	601888	中国中免	1,432,089.00	3.22
60	002707	众信旅游	1,410,325.00	3.17
61	002821	凯莱英	1,402,557.00	3.15
62	601618	中国中冶	1,394,500.00	3.13
63	300450	先导智能	1,387,235.00	3.12
64	600011	华能国际	1,374,781.00	3.09
65	601390	中国中铁	1,349,549.00	3.03
66	603799	华友钴业	1,347,939.00	3.03
67	600416	湘电股份	1,334,761.00	3.00
68	601336	新华保险	1,323,095.00	2.97
69	002233	塔牌集团	1,309,673.00	2.94
70	600018	上港集团	1,296,615.00	2.91
71	600031	三一重工	1,293,929.00	2.91
72	002008	大族激光	1,293,624.00	2.91
73	002202	金风科技	1,260,493.00	2.83
74	300073	当升科技	1,230,605.00	2.76
75	603392	万泰生物	1,225,621.00	2.75
76	002714	牧原股份	1,217,398.00	2.74
77	603985	恒润股份	1,216,579.00	2.73
78	300316	晶盛机电	1,213,954.00	2.73
79	600029	南方航空	1,210,884.00	2.72
80	600886	国投电力	1,209,636.00	2.72
81	002044	美年健康	1,206,586.00	2.71
82	601799	星宇股份	1,203,658.00	2.70
83	002812	恩捷股份	1,196,192.00	2.69
84	002271	东方雨虹	1,188,081.00	2.67
85	000069	华侨城 A	1,187,760.00	2.67
86	000800	一汽解放	1,186,499.00	2.67
87	600848	上海临港	1,174,753.00	2.64
88	601988	中国银行	1,173,914.00	2.64
89	601100	恒立液压	1,166,547.00	2.62
90	601166	兴业银行	1,149,480.00	2.58
91	300772	运达股份	1,135,868.00	2.55
92	601111	中国国航	1,133,760.00	2.55
93	300760	迈瑞医疗	1,105,856.00	2.48
94	600399	抚顺特钢	1,096,595.00	2.46
95	688561	奇安信	1,080,666.15	2.43
96	002179	中航光电	1,055,756.00	2.37
97	002324	普利特	1,052,851.00	2.37

98	600801	华新水泥	1,050,001.00	2.36
99	600276	恒瑞医药	1,036,479.00	2.33
100	601288	农业银行	1,009,904.00	2.27
101	000807	云铝股份	1,002,751.00	2.25
102	601877	正泰电器	999,093.00	2.24
103	601398	工商银行	998,006.00	2.24
104	600606	绿地控股	998,005.00	2.24
105	600009	上海机场	960,587.00	2.16
106	600570	恒生电子	952,634.00	2.14
107	688388	嘉元科技	946,937.21	2.13
108	600197	伊力特	943,011.00	2.12
109	600893	航发动力	938,496.00	2.11
110	300777	中简科技	936,870.00	2.10
111	300498	温氏股份	932,068.00	2.09
112	002415	海康威视	919,597.00	2.07
113	688408	中信博	912,097.13	2.05
114	600999	招商证券	897,901.00	2.02
115	600588	用友网络	895,726.00	2.01

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

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	300,813,941.27
卖出股票收入（成交）总额	302,134,758.61

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	305,714.79	0.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	305,714.79	0.66

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019658	21 国债 10	3,000	305,714.79	0.66

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

江西赣锋锂业股份有限公司

2022 年 1 月 24 日，江西赣锋锂业股份有限公司因涉嫌 A 股某上市公司股票二级市场内幕交易，被中国证监会于 2022 年 1 月 24 日立案调查。

招商银行股份有限公司

招商银行股份有限公司部分分行或支行因存在部分流动资金贷款违规流入房地产市场，违反清算管理规定、违反人民币银行结算账户管理相关规定，违反假币收缴鉴定管理相关规定、违反人民币管理相关规定，违反代理国库业务相关规定，超过期限或未向中国人民银行报送账户开立资料，未办妥抵押预告登记发放个人住房抵押贷款，未按照保险公司提供的销售合同条款全面、客观揭示所代销保险产品风险，贷后管理严重违反审慎经营规则，未严格审查票据业务贸易背景真实性、未有效跟踪检查贴现资金使用情况，委托贷款资金来源审核不到位，委托资金来源于本

行信贷资金，保理业务管理不尽职、资金被挪用，款“三查”不尽职，信贷资金被挪用，违规办理银行承兑汇票，发卡授信不审慎，严重违反审慎经营规则，等多条违法违规行为，被各地中国银行保险监督管理委员会派出机构处以警告或罚款。同时，招商银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差，漏报贷款核销业务 EAST 数据等十三项违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会处以罚款 300 万元。

报告期内除上述主体外，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	486,652.58
2	应收清算款	785,882.05
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	5,011,682.40
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,284,217.03

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
德邦量化 优选股票 A	587	20,017.92	5,299,215.08	45.10	6,451,301.78	54.90
德邦量化 优选股票 C	508	44,913.31	20,560,083.57	90.11	2,255,876.69	9.89
合计	1,095	31,567.56	25,859,298.65	74.81	8,707,178.47	25.19

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	德邦量化优选股票 A	1,435.33	0.0122
	德邦量化优选股票 C	12,880.14	0.0565
	合计	14,315.47	0.0414

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、 基金投资和相关部门 负责人持有本开放式 基金	德邦量化优选股票 A	0
	德邦量化优选股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	德邦量化优选股票 A	0
	德邦量化优选股票 C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
基金合同生效日 (2017 年 3 月 24 日) 基金份额总额	86,793,545.80	114,236,860.64
本报告期期初基金份 额总额	6,973,985.45	23,410,062.57
本报告期基金总申购	7,093,549.96	11,787,607.97

份额		
减：本报告期基金总赎回份额	2,317,018.55	12,381,710.28
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	11,750,516.86	22,815,960.26

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安证券	2	248,924,021.74	41.28	231,822.98	43.98	—
兴业证券	2	181,656,275.	30.13	169,178.04	32.10	—

		63				
大通证券	1	97,913,480.31	16.24	71,600.56	13.59	-
光大证券	2	74,454,922.20	12.35	54,449.32	10.33	-
广州证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择基金专用交易席位的基本选择标准：

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

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

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

2、本报告期内，本基金无新增或减少租用交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	300,150.00	100.00	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

广州证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	德邦基金管理有限公司关于旗下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
4	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
5	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
6	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
7	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 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
8	关于德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2022 年 2 月 23 日
9	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
10	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
11	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源西部为销售机构、开通定期定额投资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 3 月 4 日
12	关于德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2022 年 3 月 9 日
13	关于德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2022 年 3 月 16 日

14	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 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
15	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
16	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
17	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 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攀赢基金暂停销售德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 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
22	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安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 15 日
23	德邦基金管理有限公司关于德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 增加中正达广为销售机构的公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2022 年 6 月 16 日
24	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告	中国证监会规定网站及规定报刊	2022 年 6 月 18 日
25	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2022 年第 1 号)	中国证监会规定网站及规定报刊	2022 年 6 月 21 日
26	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) (德邦量化优选股票 C (份额简称: 优选 C) 份额) 基金产品资料概要 (更新)	中国证监会规定网站及规定报刊	2022 年 6 月 21 日
27	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) (德邦量化优选股票 A (场内简称: 量化优选) 份额) 基金产品资料概要 (更新)	中国证监会规定网站及规定报刊	2022 年 6 月 21 日
28	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20220630	16,221,243.47	0.00	0.00	16,221,243.47	46.9300
产品特有风险							
1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响； 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动； 4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； 5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，本基金将按照基金合同的约定，进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会审议，其他投资者可能面临基金提前终止的风险； 6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； 7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。							

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金合同；
- 3、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金托管协议；

- 4、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内按照规定披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-821-7788

德邦基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日