

德邦优化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：德邦基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2023 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	65
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	65
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	69
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	德邦优化
基金主代码	770001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月25日
基金管理人	德邦基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	163,519,687.76份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型证券投资基金，依靠对宏观经济周期的判断，结合数量化投资模型，灵活配置基金资产于各类风险资产，并同时精选个股与个券，通过上述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	本基金强调自上而下的投资策略，通过对经济周期、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，调整投资组合配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+一年期银行定期存款利率（税后）×60%
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高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		德邦基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张秀玉	陆志俊
	联系电话	021-26010852	95559
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008217788	95559
传真		021-26010808	021-62701216
注册地址		上海市虹口区东大名路501号503B单元	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市黄浦区中山东二路600号S1幢2101-2106单元	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200010	200336
法定代表人		左畅	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
----------------	-------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dbfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	德邦基金管理有限公司	上海市虹口区东大名路501号503B单元

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-24,730,717.38	51,114,875.97	32,205,946.07
本期利润	-49,416,153.79	30,454,963.54	44,538,441.32
加权平均基金份额本期利润	-0.3039	0.2912	0.4730
本期加权平均净值利润率	-19.47%	16.91%	34.62%
本期基金份额净值增长率	-17.72%	19.12%	47.55%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	52,859,039.64	76,444,770.69	3,808,823.93
期末可供分配基金份额利润	0.3233	0.5604	0.0246
期末基金资产净值	233,465,719.42	248,664,625.02	237,353,330.62
期末基金份额净值	1.4278	1.8230	1.5304
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	189.42%	251.77%	195.31%

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

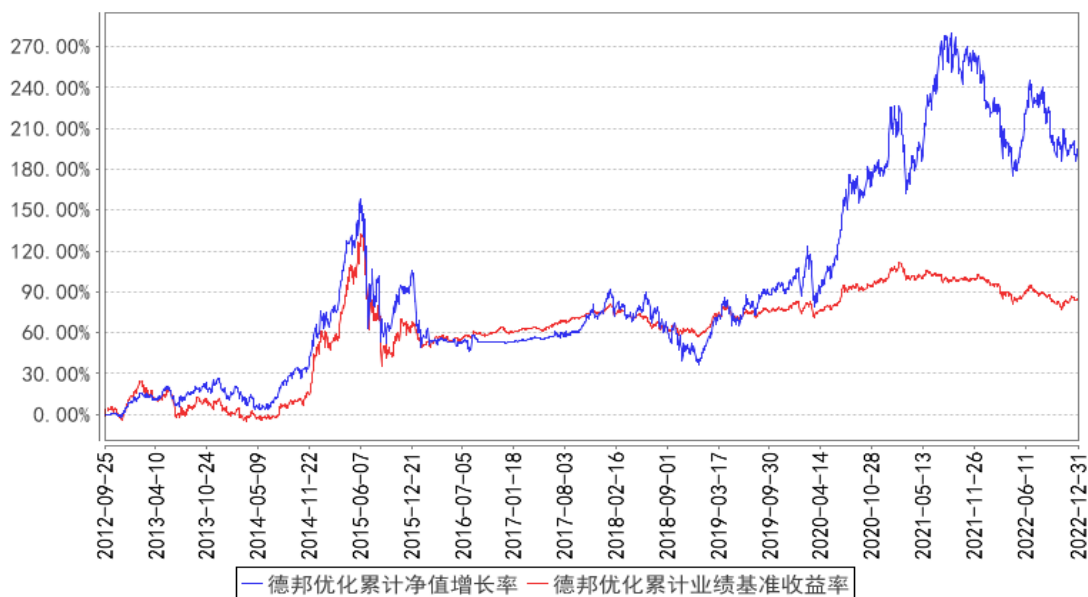
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.61%	1.22%	1.05%	0.52%	-2.66%	0.70%
过去六个月	-16.14%	1.23%	-5.11%	0.44%	-11.03%	0.79%
过去一年	-17.72%	1.36%	-8.03%	0.51%	-9.69%	0.85%
过去三年	44.61%	1.53%	1.95%	0.52%	42.66%	1.01%
过去五年	64.60%	1.44%	5.52%	0.52%	59.08%	0.92%
自基金合同生效起至今	189.42%	1.44%	84.29%	1.02%	105.13%	0.42%

注：本基金份额持有人大会于 2015 年 12 月 15 日表决通过了《关于德邦优化配置股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自 2015 年 12 月 15 日起，本基金由“德邦优化配置股票型证券投资基金”变更为“德邦优化灵活配置混合型证券投资基金”，业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%”变更为“沪深 300 指数收益率×40%+一年期银行定期存款利率（税后）×60%”。

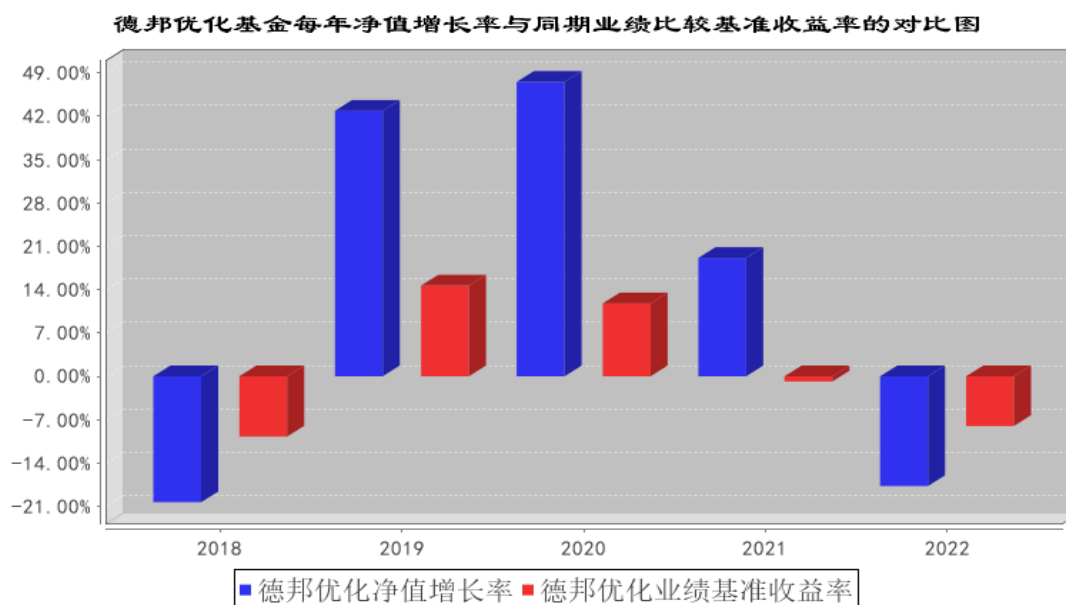
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

德邦优化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：本基金份额持有人大会于 2015 年 12 月 15 日表决通过了《关于德邦优化配置股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自 2015 年 12 月 15 日起，本基金由“德邦优化配置股票型证券投资基金”变更为“德邦优化灵活配置混合型证券投资基金”，基金转型起至报告期期末，本基金运作时间已满一年。业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%”变更为“沪深 300 指数收益率×40%+一年期银行定期存款利率（税后）×60%”。本基金的基金合同生效日为 2012 年 09 月 25 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满 1 年。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2012 年 09 月 25 日至 2022 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为 2012 年 9 月 25 日，2012 年度数据根据合同生效当年实际存续期（2012 年 9 月 25 日至 2012 年 12 月 31 日）计算，不按照整个自然年度进行折算。本基金份额持有人大会于 2015 年 12 月 15 日表决通过了《关于德邦优化配置股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自 2015 年 12 月 15 日起，本基金由“德邦优化配置股票型证券投资基金”变更为“德邦优化灵活配置混合型证券投资基金”，业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%”变更为“沪深 300 指数收益率×40%+一年期银行定期存款利率（税后）×60%”。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	0.7200	9,347,629.20	2,723,182.66	12,070,811.86	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	1.4000	18,776,276.18	435,719.55	19,211,995.73	-
合计	2.1200	28,123,905.38	3,158,902.21	31,282,807.59	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

德邦基金管理有限公司经中国证监会（证监许可[2012]249 号）批准，于 2012 年 3 月 27 日正式成立。股东为德邦证券股份有限公司、西子联合控股有限公司、浙江省土产畜产进出口集团有限公司，注册资本为 5.9 亿元人民币。公司以坦诚、高效、公平、有爱、创新、进取、担当、

共赢为企业文化，以市场需求为导向，以客户服务为中心，以创造价值为目标，为客户成就财富梦想，为股东实现利润回报，为员工搭建发展平台，为社会履行企业责任。

截止 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理三十三只开放式基金：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦民裕进取量化精选灵活配置混合型证券投资基金、德邦乐享生活混合型证券投资基金、德邦新添利债券型证券投资基金、德邦锐兴债券型证券投资基金、德邦景颐债券型证券投资基金、德邦锐乾债券型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、德邦如意货币市场基金、德邦锐泓债券型证券投资基金、德邦短债债券型证券投资基金、德邦德瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、德邦锐恒 39 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、德邦大消费混合型证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金、德邦锐泽 86 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、德邦沪港深龙头混合型证券投资基金、德邦锐裕利率债债券型证券投资基金、德邦安顺混合型证券投资基金、德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金、德邦价值优选混合型证券投资基金、德邦 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、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		
汪晖	本基金的基金经理	2020 年 4 月 28 日	-	28 年	硕士，曾任华泰证券股份有限公司研究员、投资经理、高级投资经理，华宝信托公司信托基金经理，华泰柏瑞基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、投资总监，具有 20 年以上的证券投资管理经验。2014 年 8 月加入德邦基金管理有限公司，现任公司副总经理、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦新添利债券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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

注：本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

监察稽核部门对投资交易行为进行定期或不定期检查，重点关注公平交易的执行情况和异常交易行为的监控情况。严禁同一受托资产的同日反向交易及其他可能导致不公平或利益输送的交易行为，但完全按照有关指数构成比例进行证券投资的受托资产除外。严格控制不同受托资产间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易或利益输送的同日反向交易行为。监察稽核部门对不同受托资产，尤其是同一位基金经理或投资经理管理的不同受托资产同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同受托资产临近交易日的同向交易和反向交易的交易时

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

注：本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年，全球宏观环境波动加剧，美欧等国家持续加息，对全球资本市场流动性和资产价格带来了不利影响；俄乌战争持续，欧洲能源问题加剧，助推了全球性通货膨胀。中国新冠疫情的反复和冲击给中国经济和人们的信心造成巨大的冲击。诸多负面因素影响股票市场投资者信心，降低风险偏好。同时疫情也从供给端，需求端和供应链几个方面严重影响上市公司的经营状况，公司业绩整体承压，盈利能力下滑。全年来看，沪深 300 指数下跌超过 21%，上证指数下跌 15%，创业板指数下跌超过 29%。

本基金在 2022 年总体上遵循景气持续和景气反转逻辑制定投资策略和构建投资组合，有得有失。由于风险偏好下降，整体市场估值下降不利于成长股，因此成长股估值承压，价值股相对受益。由于能源危机的影响全年煤炭行业表现最佳，行业收益率超过 10%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4278 元；本报告期基金份额净值增长率为-17.72%，业绩比较基准收益率为-8.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

相比于 2022 年，2023 年中国经济和中国股票市场有一个共同的主题—重启，宏观经济和股票市场从底部向上复苏是大概率事件。展望 2023 年宏观经济环境和增长动力，可以看到有几个方面的力量将起作用。第一，货币政策强调精准有力，财政政策加力提效。稳货币，扩信用，持续发挥政策性开发性金融工具的作用，重点促消费，扩投资。宏观政策层面有利于保持股票市场的流动性和实体经济的恢复。第二，经济的内生周期性作用。2021 年年中本轮经济上行周期见到高点，2023 年宏观经济周期很可能迎来库存周期低点，新一轮库存周期上行带给经济内生动力。各个行业在不同时点将轮动复苏，助力股票市场风险偏好回升及上市公司业绩触底回升。但需要明确的是复苏之路绝非坦途。疫情之后信心重建需要时间，不可能一蹴而就。预期和现实之间的差距一定会给市场带来波折和振荡。另一方面，我们也观察到美国通胀的韧性，美联储加息周期尚未结束，美国经济仍处于去库存周期开始阶段。中美经济周期的错位导致中国经济不同于以往的周期共振，复苏力度大幅减弱。因此，总体来看，中国经济在 2023 年将运行在底部向上重启的轨迹上，但力度和速度需要观察和耐心等待。从股票市场来看，保持耐心和信心，循着本轮经济复苏发力点和增长快的方向布局行业 and 选择个股是投资致胜的关键。

本基金认为 2023 年内需相关行业和房地产产业链将迎来否极泰来的拐点，如大消费，旅游出行，家电，家居建材等。其次，数字经济是投资的重点方向，承接新基建的着力点。第三，周期性行业一定不会缺席新一轮库存周期带来的繁荣。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

合规管理方面，2022 年，公司董事会、监事会、经营管理层、各层级部门及人员、子公司继续贯彻落实各自合规管理职责，深入理解法律法规和自律规则，并在经营决策、运营管理和执业行为过程中识别、防范及化解合规风险。2022 年，公司总体上实现了通过建立和执行合规管理制

度和机制，有效识别和防范合规风险，保护投资者合法权益，维护股东、公司及全体员工合法利益的合规管理要求。风险管理方面，2022 年，公司继续加强全面风险管理工作，风险管理覆盖公司各项业务、各个部门或机构和各级人员，并贯穿到决策、执行、监督、反馈等各个环节，有效识别、化解和防范各类风险。稽核审计方面，2022 年，稽核审计工作继续加大对投资、研究、交易、销售、登记注册、基金估值等关键业务环节以及监管关注重点问题的检查力度，并及时跟踪各项工作整改进度，督促相关部门完善制度、流程，保障公司各项业务稳步开展。

综合以上情况，2022 年，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续加强内部合规控制、风险管理以及稽核审计工作，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《德邦基金管理有限公司基金估值业务管理制度》、《德邦基金管理有限公司估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。估值委员会主要由公司分管运营的副总经理、分管投资的副总经理或投资总监、督察长、投资研究条线负责人、基金经理（或投资经理）、基金运营部、监察稽核部代表及风险控制人员等组成。估值委员会主要负责根据相关法律法规及公司章程，拟定公司的估值政策、估值原则，确定估值程序、流程、职责分工并提出估值意见；对投资品种需要提供特殊定价时，研究相关估值政策和估值模型，提供和评估估值技术；在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，制定投资品种采用的相关估值模型、假设及参数；评价估值用外部信息的客观性和可靠程度；保证基金估值的公允性，维护基金持有人的利益；监督估值政策、估值程序及估值调整的执行情况等。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内德邦优化灵活配置混合型证券投资基金实施利润分配为人民币 12,070,811.86 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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合规守信情况声明

2022 年度，基金托管人在德邦优化灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2022 年度，德邦基金管理有限公司在德邦优化灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2022 年度，由德邦基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关德邦优化灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 60982868_B02 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了德邦优化灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的德邦优化灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了德邦优化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分

	<p>进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于德邦优化灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>德邦优化灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估德邦优化灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督德邦优化灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对德邦优化灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致德邦优化灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔺育化 徐雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
审计报告日期	2023 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：德邦优化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	31,776,164.20	31,457,751.79
结算备付金		74,037.91	1,140,427.52
存出保证金		268,287.54	161,213.57
交易性金融资产	7.4.7.2	201,632,695.29	218,896,798.36
其中：股票投资		201,632,695.29	218,896,798.36
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		4,812,777.54	-
应收股利		-	-
应收申购款		25,972.23	66,530.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	7,665.17
资产总计		238,589,934.71	251,730,386.84
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,374,324.12	2,093,487.76
应付赎回款		58,175.25	53,175.58
应付管理人报酬		274,988.52	313,008.73
应付托管费		45,831.44	52,168.13
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	370,895.96	553,921.62
负债合计		5,124,215.29	3,065,761.82
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	163,519,687.76	136,401,251.41
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	69,946,031.66	112,263,373.61
净资产合计		233,465,719.42	248,664,625.02
负债和净资产总计		238,589,934.71	251,730,386.84

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，德邦优化基金份额净值 1.4278 元，基金份额总额 163,519,687.76 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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：德邦优化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-44,736,416.12	36,229,547.89
1. 利息收入		289,994.64	212,786.15
其中：存款利息收入	7.4.7.13	289,994.64	169,231.38
债券利息收入		-	43,554.77
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）		-20,434,361.68	56,134,375.59
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-22,467,627.85	55,568,358.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-47,492.33	83,019.30
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,080,758.50	482,997.60
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-24,685,436.41	-20,659,912.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	93,387.33	542,298.58
减：二、营业总支出		4,679,737.67	5,774,584.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,797,732.30	2,703,818.91
2. 托管费	7.4.10.2.2	632,955.37	450,636.53
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.05
8. 其他费用	7.4.7.23	249,050.00	2,620,128.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-49,416,153.79	30,454,963.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-49,416,153.79	30,454,963.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-49,416,153.79	30,454,963.54

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 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：德邦优化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	136,401,251.41	-	112,263,373.61	248,664,625.02
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 ）	136,401,251.41	-	112,263,373.61	248,664,625.02
三、本 期 增 减 变 动 额 （ 减 少 以 “-” 号 填 列 ）	27,118,436.35	-	-42,317,341.95	-15,198,905.60
（一）、 综 合 收 益 总 额	-	-	-49,416,153.79	-49,416,153.79
（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 ）	27,118,436.35	-	19,169,623.70	46,288,060.05
其中：1. 基 金 申 购 款	89,327,748.58	-	51,094,181.87	140,421,930.45
2. 基 金 赎 回 款	-62,209,312.23	-	-31,924,558.17	-94,133,870.40
（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 ）	-	-	-12,070,811.86	-12,070,811.86
（四）、其 他 综 合 收 益 结 转 留 存 收 益	-	-	-	-
四、本 期 期 末 净 资	163,519,687.76	-	69,946,031.66	233,465,719.42

项目	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
产（基金净值）				
一、上期期末净资产（基金净值）	155,088,985.60	-	82,264,345.02	237,353,330.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产（基金净值）	155,088,985.60	-	82,264,345.02	237,353,330.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-18,687,734.19	-	29,999,028.59	11,311,294.40
（一）、综合收益总额	-	-	30,454,963.54	30,454,963.54
（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）	-18,687,734.19	-	-455,934.95	-19,143,669.14
其中：1. 基金申购款	213,441,526.17	-	165,127,483.27	378,569,009.44
2. 基金赎回款	-232,129,260.36	-	-165,583,418.22	-397,712,678.58
（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、本期末净资产（基金净值）	136,401,251.41	-	112,263,373.61	248,664,625.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

德邦优化灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),原德邦优化配置股票型证券投资基金,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[2012]941号文《关于核准德邦优化配置股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人德邦基金管理有限公司向社会公开发行为募集,基金合同于2012年9月25日正式生效,首次设立募集规模为323,120,876.78份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为德邦基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

德邦优化配置股票型证券投资基金基金份额持有人大会于2015年12月15日表决讨论通过了《关于德邦优化配置股票型证券投资基金转型有关事项的议案》,大会决议自该日起生效,决议事项已向中国证监会的备案。自2015年12月15日起,由《德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《德邦优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,原《德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同》同日起失效。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具、

债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债券、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等）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×40%+一年期银行定期存款利率（税后）×60%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

- (1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调

整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次期末可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分

配；期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号）。

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。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

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 31,457,751.79 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 7,030.77 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 31,464,782.56 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 1,140,427.52 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 513.20 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 1,140,940.72 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 161,213.57 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 72.60 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 161,286.17 元。

应收申购款于 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 66,530.43 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 48.60 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，应收申购款于 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 66,579.03 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 7,665.17 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 7,030.77 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 513.20 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 72.60 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 48.60 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（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。

7.4.6.4 企业所得税

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

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

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

7.4.6.5 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	31,776,164.20	31,457,751.79
等于：本金	31,769,920.00	31,457,751.79
加：应计利息	6,244.20	-
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	31,776,164.20	31,457,751.79

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		228,994,897.48	-	201,632,695.29	-27,362,202.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		228,994,897.48	-	201,632,695.29	-27,362,202.19
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		221,573,564.14	-	218,896,798.36	-2,676,765.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		221,573,564.14	-	218,896,798.36	-2,676,765.78

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 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。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末不存在按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

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

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

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

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	7,665.17
其他应收款	-	-

待摊费用	-	-
合计	-	7,665.17

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	215.65	175.85
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	160,680.31	373,745.77
其中：交易所市场	160,680.31	373,745.77
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	90,000.00	60,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	370,895.96	553,921.62

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,401,251.41	136,401,251.41
本期申购	89,327,748.58	89,327,748.58
本期赎回（以“-”号填列）	-62,209,312.23	-62,209,312.23
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	163,519,687.76	163,519,687.76

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	76,444,770.69	35,818,602.92	112,263,373.61
本期利润	-24,730,717.38	-24,685,436.41	-49,416,153.79
本期基金份额交易产生的变动数	13,215,798.19	5,953,825.51	19,169,623.70
其中：基金申购款	35,897,534.99	15,196,646.88	51,094,181.87
基金赎回款	-22,681,736.80	-9,242,821.37	-31,924,558.17

本期已分配利润	-12,070,811.86	-	-12,070,811.86
本期末	52,859,039.64	17,086,992.02	69,946,031.66

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	273,266.56	155,270.96
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	13,331.27	10,421.87
其他	3,396.81	3,538.55
合计	289,994.64	169,231.38

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-22,467,627.85	55,568,358.69
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	-22,467,627.85	55,568,358.69

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,152,516,698.25	874,164,525.09
减：卖出股票成本总额	1,171,848,379.93	818,596,166.40
减：交易费用	3,135,946.17	-
买卖股票差价收入	-22,467,627.85	55,568,358.69

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益**7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	17,670.13	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-65,162.46	83,019.30
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	-47,492.33	83,019.30

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,955,342.60	6,100,484.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,000,656.98	5,915,720.00
减：应计利息总额	19,498.08	101,745.44
减：交易费用	350.00	-
买卖债券差价收入	-65,162.46	83,019.30

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益**7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
股票投资产生的股利收益	2,080,758.50	482,997.60
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	2,080,758.50	482,997.60

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-24,685,436.41	-20,659,912.43
股票投资	-24,685,436.41	-20,579,850.53
债券投资	-	-80,061.90
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	-24,685,436.41	-20,659,912.43

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	68,358.12	542,207.42
基金转换费收入	25,029.21	91.16
合计	93,387.33	542,298.58

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。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	90,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	1,550.00	1,630.00
账户维护费	36,000.00	36,900.00
其他	1,500.00	300.00
交易费用	-	2,401,298.86

合计	249,050.00	2,620,128.86
----	------------	--------------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
德邦基金管理有限公司（“德邦基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
德邦证券股份有限公司（“德邦证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
西子联合控股有限公司	基金管理人的股东
浙江省土产畜产进出口集团有限公司	基金管理人的股东
德邦创新资本有限责任公司（“德邦创新”）	基金管理人的子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
德邦证券	43,033,449.34	1.86	220,911,816.96	13.01

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
德邦证券	40,075.38	2.28	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
德邦证券	205,735.74	15.26	39,472.26	10.56

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	3,797,732.30
其中：支付销售机构的客户维护费	671,129.68	432,914.87

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提。其计算公式为：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	632,955.37

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的 0.25%的年费率计提。其计算公式为：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金合同生效日(2012年9月25日)持有的基金份额	-	0.00
报告期初持有的基金份额	18,544,403.64	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	18,544,403.64
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	17,169,687.00	0.00
报告期末持有的基金份额	1,374,716.64	18,544,403.64
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.8407%	13.5955%

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

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31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	-	-	2,087,318.81	1.5300

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	31,776,164.20	273,266.56	31,457,751.79	155,270.96

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期未发生其它关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合 计	备 注
		场 内	场 外					
1	2022 年 5 月 25 日	-	2022 年 5 月 25 日	0.7200	9,347,629.20	2,723,182.66	12,070,811.86	-
合计	-	-	-	0.7200	9,347,629.20	2,723,182.66	12,070,811.86	-

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
301115	建科股	2022年	6个月	新股流	42.05	24.04	295	12,404.75	7,091.80	-

	份	8月23日		通受限							
301132	满坤科技	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	26.80	24.48	398	10,666.40	9,743.04		-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股流通受限	38.46	25.31	345	13,268.70	8,731.95		-
301152	天力锂能	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	57.00	46.64	231	13,167.00	10,773.84		-
301165	锐捷网络	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	32.38	31.61	272	8,807.36	8,597.92		-
301171	易点天下	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	18.18	17.72	486	8,835.48	8,611.92		-
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股流通受限	26.28	18.13	398	10,459.44	7,215.74		-
301227	森鹰窗业	2022年9月16日	6个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16		-
301230	泓博医药	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	40.00	48.32	247	9,880.00	11,935.04		-
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	69.68	321	10,801.65	22,367.28		-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	177	9,005.76	11,717.40		-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	303	9,905.07	26,645.82		-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70		-

301273	瑞晨环 保	2022年 10月 11日	6个月	新股流 通受限	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301276	嘉曼服 饰	2022年 9月1 日	6个月	新股流 通受限	40.66	22.61	246	10,002.36	5,562.06	-
301277	新天地	2022年 11月9 日	6个月	新股流 通受限	27.00	25.78	339	9,153.00	8,739.42	-
301280	珠城科 技	2022年 12月 19日	6个月	新股流 通受限	67.40	44.80	151	10,177.40	6,764.80	-
301285	鸿日达	2022年 9月21 日	6个月	新股流 通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301306	西测测 试	2022年 7月19 日	6个月	新股流 通受限	43.23	42.29	207	8,948.61	8,754.03	-
301308	江波龙	2022年 7月27 日	6个月	新股流 通受限	55.67	56.72	240	13,360.80	13,612.80	-
301309	万得凯	2022年 9月8 日	6个月	新股流 通受限	39.00	24.46	178	6,942.00	4,353.88	-
301313	凡拓数 创	2022年 9月22 日	6个月	新股流 通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云 通	2022年 9月29 日	6个月	新股流 通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301318	维海德	2022年 8月3 日	6个月	新股流 通受限	64.68	41.74	119	7,696.92	4,967.06	-
301319	唯特偶	2022年 9月22 日	6个月	新股流 通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301327	华宝新 能	2022年 9月8 日	6个月	新股流 通受限	237.50	176.97	121	28,737.50	21,413.37	-
301328	维峰电 子	2022年 8月30 日	6个月	新股流 通受限	78.80	76.96	125	9,850.00	9,620.00	-
301330	熵基科 技	2022年 8月10	6个月	新股流 通受限	43.32	31.31	379	16,418.28	11,866.49	-

		日									
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	138.88	103.52	53	7,360.64	5,486.56		-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股流通受限	63.00	43.33	160	10,080.00	6,932.80		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	320	9,811.20	12,112.00		-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	163	10,652.05	7,349.67		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	76	9,110.88	13,359.28		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	262	5,850.46	4,852.24		-
301379	天山电子	2022年10月19日	6个月	新股流通受限	31.51	24.63	401	12,635.51	9,876.63		-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	25.88	21.60	282	7,298.16	6,091.20		-
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股流通受限	22.50	17.16	540	12,150.00	9,266.40		-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	99	9,504.00	8,016.03		-
688420	美腾科技	2022年12月1日	6个月	新股流通受限	48.96	39.04	1,204	58,947.84	47,004.16		-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截止本报告期末 2022 年 12 月 31 日，本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理，对公司建立风险管理体系和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，协助董事会进行风险管理，风险管理委员会负责起草公司风险管理战略，审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。经理层负责落实董事会拟定的风险管理政策，并对风险控制的有效执行承担责任。经理层下设风险控制委员会，协助经理层进行风险控制，风险控制委员会负责组织风险管理体系的建设，确定风险管理原则、目标和方法，审议风险管理制度和流程，指导重大风险事件的处理。督察长负责监督检查公司风险管理工作的执行情况，评价公司内部风险控制制度的合法性、合规性和有效性，并向董事会报告。监察稽核部门为日常风险管理的执行部门，主要负责对公司经营管理和受托投资风险的预警和事中控制，对有关风险进行分析并向经理层汇报。公司各部门是风险控制措施的执行部门，负责识别和控制业务活动中潜在风险，做好风险的事先防范。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

于 2022 年 12 月 31 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。（于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有上述资产。）

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产

的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持的所有证券均在证券交易所交易，因此，除附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	31,776,164.20	-	-	-	-	-	31,776,164.20
结算备付金	74,037.91	-	-	-	-	-	74,037.91
存出保证金	268,287.54	-	-	-	-	-	268,287.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-201,632,695.29	201,632,695.29
应收申购款	-	-	-	-	-	25,972.23	25,972.23
应收清算款	-	-	-	-	-	4,812,777.54	4,812,777.54
资产总计	32,118,489.65	-	-	-	-	-206,471,445.06	238,589,934.71
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	58,175.25	58,175.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	274,988.52	274,988.52
应付托管费	-	-	-	-	-	45,831.44	45,831.44
应付清算款	-	-	-	-	-	4,374,324.12	4,374,324.12
其他负债	-	-	-	-	-	370,895.96	370,895.96
负债总计	-	-	-	-	-	5,124,215.29	5,124,215.29
利率敏感度缺口	32,118,489.65	-	-	-	-	-201,347,229.77	233,465,719.42
上年度末 2021 年 12 月 31	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

目							
资产							
银行存款	31,457,751.79	-	-	-	-	-	31,457,751.79
结算备付金	1,140,427.52	-	-	-	-	-	1,140,427.52
存出保证金	161,213.57	-	-	-	-	-	161,213.57
交易性金融资产	-	-	-	-	-	218,896,798.36	218,896,798.36
应收申购款	-	-	-	-	-	66,530.43	66,530.43
其他资产	-	-	-	-	-	7,665.17	7,665.17
资产总计	32,759,392.88	-	-	-	-	218,970,993.96	251,730,386.84
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,093,487.76	2,093,487.76
应付赎回款	-	-	-	-	-	53,175.58	53,175.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	313,008.73	313,008.73
应付托管费	-	-	-	-	-	52,168.13	52,168.13
其他负债	-	-	-	-	-	553,921.62	553,921.62
负债总计	-	-	-	-	-	3,065,761.82	3,065,761.82
利率敏感度缺口	32,759,392.88	-	-	-	-	-215,905,232.14	248,664,625.02

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2021 年 12 月 31 日：未持有的交易性债券投资），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市和的股票，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	201,632,695.29	86.37	218,896,798.36	88.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	201,632,695.29	86.37	218,896,798.36	88.03

注：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0-95%，投资于债券、债券回购、货币市场工具、现金、银行存款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不低于基金资产的 5%；每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈现线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	沪深 300 上升 1%	1,893,360.61	2,444,201.01
	沪深 300 下降 1%	-1,893,360.61	-2,444,201.01

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	201,211,854.56	217,058,558.42
第二层次	-	142,422.41
第三层次	420,840.73	1,695,817.53
合计	201,632,695.29	218,896,798.36

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票资产	
期初余额	-	1,766,427.89	1,766,427.89
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	454,915.86	454,915.86
转出第三层次	-	1,766,427.89	1,766,427.89
当期利得或损失总额	-	-34,075.13	-34,075.13
其中：计入损益的利得或损失	-	-34,075.13	-34,075.13
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	420,840.73	420,840.73
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-34,075.13	-34,075.13
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票资产	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,268,685.93	1,268,685.93
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	497,741.96	497,741.96
其中：计入损益的利得或损失	-	497,741.96	497,741.96
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,766,427.89	1,766,427.89
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	497,741.96	497,741.96

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	420,840.73	平均价格亚式期权模型	股价预期年化波动率	0.1891-2.4756	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,766,427.89	平均价格 亚式期权 模型	股价预期年化波动率	0.1717- 2.4442	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2023 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	201,632,695.29	84.51
	其中：股票	201,632,695.29	84.51
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	31,850,202.11	13.35
8	其他各项资产	5,107,037.31	2.14
9	合计	238,589,934.71	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	24,785,500.00	10.62
C	制造业	123,855,060.39	53.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	32,523,537.00	13.93
H	住宿和餐饮业	11,670,000.00	5.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,285.85	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	27,780.87	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	34,084.68	0.01
R	文化、体育和娱乐业	8,674,446.50	3.72
S	综合	-	-
	合计	201,632,695.29	86.37

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601111	中国国航	1,250,000	13,250,000.00	5.68

2	600754	锦江酒店	200,000	11,670,000.00	5.00
3	600123	兰花科创	800,000	10,672,000.00	4.57
4	600885	宏发股份	253,400	8,466,094.00	3.63
5	600521	华海药业	380,000	8,306,800.00	3.56
6	603885	吉祥航空	500,000	8,090,000.00	3.47
7	600600	青岛啤酒	73,400	7,890,500.00	3.38
8	300627	华测导航	280,000	7,784,000.00	3.33
9	002444	巨星科技	400,000	7,592,000.00	3.25
10	600009	上海机场	120,000	6,925,200.00	2.97
11	600809	山西汾酒	23,800	6,782,762.00	2.91
12	600348	华阳股份	470,000	6,697,500.00	2.87
13	600426	华鲁恒升	199,930	6,627,679.50	2.84
14	600563	法拉电子	40,000	6,395,200.00	2.74
15	600328	中盐化工	400,000	5,876,000.00	2.52
16	600141	兴发集团	200,000	5,800,000.00	2.48
17	300144	宋城演艺	356,200	5,200,520.00	2.23
18	603369	今世缘	100,000	5,090,000.00	2.18
19	002056	横店东磁	260,000	4,872,400.00	2.09
20	002011	盾安环境	360,000	4,726,800.00	2.02
21	601966	玲珑轮胎	230,000	4,710,400.00	2.02
22	000552	靖远煤电	1,500,000	4,710,000.00	2.02
23	600004	白云机场	283,700	4,258,337.00	1.82
24	600779	水井坊	50,000	4,221,000.00	1.81
25	601100	恒立液压	60,000	3,789,000.00	1.62
26	002906	华阳集团	110,000	3,654,200.00	1.57
27	603103	横店影视	235,300	3,468,322.00	1.49
28	300041	回天新材	200,000	3,264,000.00	1.40
29	002304	洋河股份	20,000	3,210,000.00	1.37
30	000822	山东海化	400,000	3,156,000.00	1.35
31	000338	潍柴动力	300,000	3,054,000.00	1.31
32	600256	广汇能源	300,000	2,706,000.00	1.16
33	000707	双环科技	200,000	1,884,000.00	0.81
34	300673	佩蒂股份	99,950	1,764,117.50	0.76
35	000725	京东方 A	500,000	1,690,000.00	0.72
36	300408	三环集团	50,000	1,535,500.00	0.66
37	688363	华熙生物	10,000	1,352,800.00	0.58
38	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.03
39	688420	美腾科技	1,204	47,004.16	0.02
40	301269	华大九天	303	26,645.82	0.01
41	301239	普瑞眼科	321	22,367.28	0.01
42	301327	华宝新能	121	21,413.37	0.01
43	301308	江波龙	240	13,612.80	0.01
44	301367	怡和嘉业	76	13,359.28	0.01

45	301363	美好医疗	320	12,112.00	0.01
46	301230	泓博医药	247	11,935.04	0.01
47	301330	熵基科技	379	11,866.49	0.01
48	301267	华夏眼科	177	11,717.40	0.01
49	301152	天力锂能	231	10,773.84	0.00
50	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
51	301379	天山电子	401	9,876.63	0.00
52	301132	满坤科技	398	9,743.04	0.00
53	301328	维峰电子	125	9,620.00	0.00
54	301389	隆扬电子	540	9,266.40	0.00
55	301306	西测测试	207	8,754.03	0.00
56	301277	新天地	339	8,739.42	0.00
57	301139	元道通信	345	8,731.95	0.00
58	301171	易点天下	486	8,611.92	0.00
59	301165	锐捷网络	272	8,597.92	0.00
60	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
61	301391	卡莱特	99	8,016.03	0.00
62	301366	一博科技	163	7,349.67	0.00
63	301223	中荣股份	398	7,215.74	0.00
64	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
65	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
66	301115	建科股份	295	7,091.80	0.00
67	301356	天振股份	160	6,932.80	0.00
68	301280	珠城科技	151	6,764.80	0.00
69	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
70	301388	欣灵电气	282	6,091.20	0.00
71	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
72	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
73	301276	嘉曼服饰	246	5,562.06	0.00
74	301349	信德新材	53	5,486.56	0.00
75	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
76	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
77	301318	维海德	119	4,967.06	0.00
78	301368	丰立智能	262	4,852.24	0.00
79	301309	万得凯	178	4,353.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300763	锦浪科技	29,471,976.98	11.85
2	600004	白云机场	23,996,808.00	9.65
3	600328	中盐化工	23,421,998.97	9.42

4	002459	晶澳科技	21,151,365.60	8.51
5	002906	华阳集团	20,934,615.20	8.42
6	601111	中国国航	20,592,667.00	8.28
7	600123	兰花科创	19,187,397.00	7.72
8	601666	平煤股份	18,203,667.00	7.32
9	000552	靖远煤电	18,058,764.15	7.26
10	600809	山西汾酒	17,565,540.68	7.06
11	600009	上海机场	16,294,686.00	6.55
12	002539	云图控股	16,130,334.20	6.49
13	603369	今世缘	15,909,280.20	6.40
14	600521	华海药业	15,854,685.00	6.38
15	300274	阳光电源	15,586,668.00	6.27
16	600141	兴发集团	15,442,197.68	6.21
17	002812	恩捷股份	15,345,421.58	6.17
18	688116	天奈科技	14,671,015.40	5.90
19	601966	玲珑轮胎	14,319,994.00	5.76
20	600096	云天化	13,720,053.28	5.52
21	688122	西部超导	13,622,289.15	5.48
22	688599	天合光能	13,518,134.06	5.44
23	000792	盐湖股份	13,231,031.96	5.32
24	300144	宋城演艺	13,142,642.45	5.29
25	300751	迈为股份	12,866,637.00	5.17
26	600779	水井坊	12,472,956.24	5.02
27	002475	立讯精密	12,399,566.00	4.99
28	601699	潞安环能	12,304,606.00	4.95
29	600754	锦江酒店	11,704,170.34	4.71
30	600885	宏发股份	10,200,092.40	4.10
31	603520	司太立	10,108,290.00	4.07
32	603198	迎驾贡酒	10,102,106.00	4.06
33	300850	新强联	9,854,493.00	3.96
34	300627	华测导航	9,744,192.00	3.92
35	601865	福莱特	9,694,408.27	3.90
36	600315	上海家化	9,630,714.70	3.87
37	600029	南方航空	9,397,318.00	3.78
38	002444	巨星科技	9,362,646.56	3.77
39	600596	新安股份	9,332,412.00	3.75
40	603225	新风鸣	9,227,241.18	3.71
41	300073	当升科技	9,196,931.00	3.70
42	300316	晶盛机电	9,077,670.00	3.65
43	603103	横店影视	9,075,307.60	3.65
44	000807	云铝股份	8,915,968.77	3.59
45	600348	华阳股份	8,815,235.00	3.55
46	300035	中科电气	8,774,765.88	3.53

47	603806	福斯特	8,756,059.56	3.52
48	300408	三环集团	8,743,467.00	3.52
49	300699	光威复材	8,706,646.00	3.50
50	600115	中国东航	8,618,527.00	3.47
51	300748	金力永磁	8,456,614.94	3.40
52	600438	通威股份	8,239,802.44	3.31
53	600160	巨化股份	8,210,599.00	3.30
54	600054	黄山旅游	8,180,185.00	3.29
55	300750	宁德时代	8,103,831.00	3.26
56	603885	吉祥航空	8,030,184.00	3.23
57	688089	嘉必优	8,018,862.08	3.22
58	600563	法拉电子	7,975,798.00	3.21
59	600600	青岛啤酒	7,969,791.00	3.21
60	600884	杉杉股份	7,739,237.00	3.11
61	601985	中国核电	7,694,516.35	3.09
62	300034	钢研高纳	7,647,989.37	3.08
63	600409	三友化工	7,638,790.00	3.07
64	300124	汇川技术	7,635,782.00	3.07
65	603260	合盛硅业	7,629,378.00	3.07
66	600309	万华化学	7,607,426.00	3.06
67	600346	恒力石化	7,495,166.21	3.01
68	300673	佩蒂股份	7,485,739.00	3.01
69	002241	歌尔股份	7,372,777.00	2.96
70	002709	天赐材料	7,320,616.00	2.94
71	300680	隆盛科技	7,304,233.00	2.94
72	300059	东方财富	7,291,680.39	2.93
73	300351	永贵电器	7,149,244.00	2.88
74	600138	中青旅	7,062,690.00	2.84
75	601012	隆基绿能	7,014,044.20	2.82
76	601186	中国铁建	6,986,623.94	2.81
77	601390	中国中铁	6,718,000.00	2.70
78	688169	石头科技	6,696,689.30	2.69
79	002011	盾安环境	6,646,888.00	2.67
80	600426	华鲁恒升	6,610,466.40	2.66
81	002049	紫光国微	6,455,993.00	2.60
82	000822	山东海化	6,385,696.00	2.57
83	002648	卫星化学	6,366,372.00	2.56
84	688099	晶晨股份	6,345,785.60	2.55
85	603259	药明康德	6,296,609.20	2.53
86	600176	中国巨石	6,127,443.14	2.46
87	603997	继峰股份	6,065,954.30	2.44
88	600111	北方稀土	6,045,517.38	2.43
89	688188	柏楚电子	6,012,289.53	2.42

90	688667	菱电电控	5,955,025.73	2.39
91	002056	横店东磁	5,948,315.00	2.39
92	002430	杭氧股份	5,914,729.00	2.38
93	300373	扬杰科技	5,891,130.16	2.37
94	600110	诺德股份	5,662,007.00	2.28
95	600486	扬农化工	5,622,147.00	2.26
96	002549	凯美特气	5,483,620.00	2.21
97	300260	新莱应材	5,416,815.71	2.18
98	002756	永兴材料	5,373,993.00	2.16
99	600436	片仔癀	5,204,998.00	2.09
100	002402	和而泰	5,171,891.00	2.08
101	600989	宝丰能源	5,147,467.00	2.07
102	600660	福耀玻璃	5,049,182.00	2.03
103	605111	新洁能	5,030,304.00	2.02
104	688005	容百科技	5,010,680.65	2.02
105	000893	亚钾国际	5,001,267.64	2.01
106	601088	中国神华	4,992,579.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300763	锦浪科技	33,238,789.00	13.37
2	002459	晶澳科技	25,205,014.20	10.14
3	600004	白云机场	22,098,194.00	8.89
4	002539	云图控股	19,820,009.00	7.97
5	601666	平煤股份	19,319,924.15	7.77
6	600328	中盐化工	19,193,301.00	7.72
7	300274	阳光电源	19,089,788.00	7.68
8	600096	云天化	16,400,160.00	6.60
9	002812	恩捷股份	16,089,801.00	6.47
10	000792	盐湖股份	15,966,311.00	6.42
11	002906	华阳集团	15,746,856.00	6.33
12	300699	光威复材	14,825,640.00	5.96
13	688599	天合光能	14,440,955.32	5.81
14	000552	靖远煤电	14,425,176.00	5.80
15	600521	华海药业	14,357,418.28	5.77
16	688122	西部超导	14,356,734.85	5.77
17	002241	歌尔股份	13,786,341.00	5.54
18	300316	晶盛机电	13,459,037.00	5.41
19	601699	潞安环能	13,127,360.80	5.28
20	300144	宋城演艺	12,784,517.00	5.14
21	002049	紫光国微	12,693,616.00	5.10

22	002475	立讯精密	12,321,854.38	4.96
23	300751	迈为股份	12,157,625.00	4.89
24	601012	隆基绿能	11,813,021.20	4.75
25	688116	天奈科技	11,473,644.71	4.61
26	600596	新安股份	10,904,499.00	4.39
27	600029	南方航空	10,882,202.00	4.38
28	603369	今世缘	10,446,451.00	4.20
29	600809	山西汾酒	10,117,018.00	4.07
30	000807	云铝股份	10,025,365.99	4.03
31	601865	福莱特	9,919,291.00	3.99
32	600438	通威股份	9,788,532.00	3.94
33	603520	司太立	9,674,400.00	3.89
34	603260	合盛硅业	9,649,344.00	3.88
35	688005	容百科技	9,617,221.36	3.87
36	603198	迎驾贡酒	9,512,980.00	3.83
37	603806	福斯特	9,312,000.00	3.74
38	600009	上海机场	9,231,420.00	3.71
39	600141	兴发集团	9,227,268.00	3.71
40	600160	巨化股份	8,928,160.30	3.59
41	600884	杉杉股份	8,906,763.89	3.58
42	600054	黄山旅游	8,871,242.50	3.57
43	688089	嘉必优	8,759,114.24	3.52
44	601966	玲珑轮胎	8,519,974.60	3.43
45	601111	中国国航	8,490,586.00	3.41
46	600779	水井坊	8,452,582.00	3.40
47	300850	新强联	8,451,998.00	3.40
48	300124	汇川技术	8,388,781.50	3.37
49	300680	隆盛科技	8,311,462.00	3.34
50	300035	中科电气	8,291,048.92	3.33
51	603997	继峰股份	8,150,620.00	3.28
52	600115	中国东航	8,026,000.00	3.23
53	600409	三友化工	7,965,384.00	3.20
54	603225	新凤鸣	7,956,241.00	3.20
55	600309	万华化学	7,873,813.00	3.17
56	600315	上海家化	7,826,354.00	3.15
57	300059	东方财富	7,816,004.20	3.14
58	300034	钢研高纳	7,767,491.90	3.12
59	300408	三环集团	7,747,991.00	3.12
60	300073	当升科技	7,714,666.00	3.10
61	603185	上机数控	7,674,348.16	3.09
62	601985	中国核电	7,303,250.00	2.94
63	300750	宁德时代	7,084,008.00	2.85
64	300351	永贵电器	7,081,165.00	2.85

65	002531	天顺风能	7,062,573.00	2.84
66	300673	佩蒂股份	7,020,342.00	2.82
67	600346	恒力石化	6,999,925.00	2.82
68	688188	柏楚电子	6,865,441.56	2.76
69	688667	菱电电控	6,770,598.81	2.72
70	002549	凯美特气	6,760,161.00	2.72
71	000895	双汇发展	6,751,658.00	2.72
72	601390	中国中铁	6,680,000.00	2.69
73	600905	三峡能源	6,675,900.00	2.68
74	601186	中国铁建	6,624,889.00	2.66
75	002430	杭氧股份	6,600,224.00	2.65
76	002648	卫星化学	6,510,668.00	2.62
77	600989	宝丰能源	6,410,657.00	2.58
78	600138	中青旅	6,407,163.00	2.58
79	300260	新莱应材	6,296,620.00	2.53
80	600406	国电南瑞	6,240,008.00	2.51
81	600754	锦江酒店	6,221,107.00	2.50
82	002402	和而泰	6,110,313.00	2.46
83	600123	兰花科创	5,982,392.00	2.41
84	002311	海大集团	5,978,132.00	2.40
85	002709	天赐材料	5,917,848.00	2.38
86	600486	扬农化工	5,800,237.00	2.33
87	600110	诺德股份	5,695,111.00	2.29
88	002738	中矿资源	5,659,335.00	2.28
89	300748	金力永磁	5,619,901.00	2.26
90	688112	鼎阳科技	5,611,902.52	2.26
91	600887	伊利股份	5,589,514.00	2.25
92	300395	菲利华	5,558,077.00	2.24
93	600660	福耀玻璃	5,554,316.00	2.23
94	601225	陕西煤业	5,479,045.00	2.20
95	600176	中国巨石	5,436,365.00	2.19
96	002756	永兴材料	5,390,347.00	2.17
97	300861	美畅股份	5,367,486.00	2.16
98	601088	中国神华	5,310,182.00	2.14
99	603259	药明康德	5,258,000.00	2.11
100	600305	恒顺醋业	5,201,534.00	2.09
101	600460	士兰微	5,147,227.00	2.07
102	600507	方大特钢	5,032,504.40	2.02
103	600399	抚顺特钢	5,014,676.00	2.02
104	300373	扬杰科技	4,997,598.70	2.01
105	605123	派克新材	4,994,612.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,179,269,713.27
卖出股票收入（成交）总额	1,152,516,698.25

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	268,287.54
2	应收清算款	4,812,777.54
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,972.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,107,037.31

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
56,847	2,876.49	105,264,310.17	64.37	58,255,377.59	35.63

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,585,556.28	0.9696

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

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

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年9月25日） 基金份额总额	323,120,876.78
本报告期期初基金份额总额	136,401,251.41
本报告期基金总申购份额	89,327,748.58
减：本报告期基金总赎回份额	62,209,312.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	163,519,687.76

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2022 年 9 月 17 日公告，吴晨先生担任公司联席总经理。

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2022 年 10 月 26 日公告，宣培栋先生离任公司副总经理。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

11.3 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托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 9 万元整，该审计机构自基金合同生效日（2012 年 9 月 25 日）起向本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人、高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 8 月 29 日

采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正及暂停受理审核公募基金产品募集三个月、警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	投研制度修订不及时；备选库建立和维护存在缺陷；债券业务内部控制机制未能有效执行等。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	全面梳理和盘点公司制度，推动落实制度修订；严格执行隔离措施，加强相关行为管控；根据最新实际情况修订《债券库管理办法》并严格执行。
其他	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	518,580,296.55	22.37	379,243.34	21.61	-
开源证券	1	408,006,759.21	17.60	298,377.53	17.00	-
安信证券	2	280,191,902.14	12.09	204,904.93	11.67	-
国盛证券	1	254,624,487.04	10.99	186,204.83	10.61	-
民生证券	1	231,643,309.30	9.99	169,402.20	9.65	-
华创证券	2	166,465,823.48	7.18	121,736.57	6.94	-
东吴证券	1	150,664,439.48	6.50	140,313.42	7.99	-
天风证券	2	91,342,827.74	3.94	66,800.04	3.81	-
中信建投证券	2	58,870,933.54	2.54	42,464.87	2.42	-
东兴证券	2	58,186,730.77	2.51	54,190.24	3.09	-
招商证券	1	51,210,003.49	2.21	47,692.16	2.72	-
德邦证券	2	43,033,449.34	1.86	40,075.38	2.28	-

国金证券	2	5,080,106.39	0.22	3,715.09	0.21	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择基金专用交易单元的基本选择标准：

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

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

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

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

2、本报告期内，本基金新增租用中信建投、华创证券、民生证券的交易单元，减少租用天风证券的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

国盛证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年1月6日
2	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年1月12日
3	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年1月13日
4	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年1月20日
5	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2022年1月21日

		站	
6	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年2月23日
7	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年2月25日
8	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年2月26日
9	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年3月4日
10	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券、中信山东、中信华南、中信期货为销售机构、开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年3月9日
11	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金在万得基金调整申购、转换、定期定额投资业务最低限额的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年3月10日
12	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盈米基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年3月16日
13	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中植基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年3月18日
14	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年4月14日
17	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年4月19日
18	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2022年4月22日

		站	
19	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年5月6日
20	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万得基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年5月19日
21	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金分红公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年5月24日
22	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年5月25日
23	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年6月6日
24	德邦基金管理有限公司关于德邦优化灵活配置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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年6月13日
25	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年6月15日
26	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年6月21日
27	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年6月22日
28	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年7月1日
29	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加度小满为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年7月4日
30	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年7月20日
31	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加创金启富为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年7月21日
32	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联泰基金为销售机构的	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2022年7月22日

	公告	站	
33	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财通证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年8月19日
34	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年8月30日
35	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年8月31日
36	德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年9月17日
37	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加银河期货为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年9月22日
38	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年9月29日
39	德邦基金管理有限公司关于放开转换补差费折扣及开展直销平台基金转换申购补差费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年10月10日
40	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年10月25日
41	德邦基金管理有限公司关于注销江苏分公司的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年10月26日
42	德邦基金管理有限公司关于旗下基金在工商银行调整申购（含定期定额投资）最低金额、追加申购最低金额的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年11月7日
43	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华安证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年12月5日
44	德邦基金管理有限公司关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年12月26日
45	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信百信银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年12月27日
46	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金 2022 年底及 2023 年非港股通交易日暂停开放申购（含转换转	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022年12月29日

	入及定期定额投资)、赎回(含转换转出)业务的公告		
--	--------------------------	--	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20220101 - 20221221	43,319,97 6.17	-	12,682,86 4.00	30,637,112.17	18.74 00
	2	20221223 - 20221231	-	34,032, 521.11	-	34,032,521.11	20.81 00
产品特有风险							
<p>1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；</p> <p>4、单一机构投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会审议，其他投资者可能面临基金合同终止的风险；</p> <p>6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。</p>							

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022 年 9 月 17 日，基金管理人在中国证监会规定媒体及规定网站刊登了《德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，具体内容详见公告。

2022 年 10 月 26 日，基金管理人在中国证监会规定媒体及规定网站刊登了《德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，具体内容详见公告。

2022 年 10 月 26 日，基金管理人在中国证监会规定媒体及规定网站刊登了《德邦基金管

理有限公司关于注销江苏分公司的公告》，具体内容详见公告。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、德邦优化灵活配置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。

13.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-821-7788

德邦基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日