

德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式
证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：德邦基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	13
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	13
§ 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的真实、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	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62

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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
7.12 市场中性策略执行情况	63
7.13 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	64
§9 开放式基金份额变动	65
§10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	德邦量化对冲混合	
基金主代码	008838	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 29 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	36,709,051.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
下属分级基金的交易代码	008838	008839
报告期末下属分级基金的份额总额	21,139,776.05 份	15,569,275.18 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资模型，灵活采用多种策略对冲股票组合的系统性风险，在严格控制主动风险的前提下，谋求投资组合资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将通过对宏观经济环境、政策形式、证券市场走势的综合分析、国际市场变化情况等因素的深入研究，主动判断市场时机，综合评价各类资产的风险收益水平，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券、现金等各类资产类别上的投资比例，并进行动态调整。</p> <p>本基金主要通过考量现阶段的基差率来调整股票资产的配置比例。具体而言，本基金将基于国内股指期货市场的现状，根据上期沪深 300 股指期货当月合约的基差率的高低决定股票资产的投资比例。当基差率处于历史较高水平时，股指期货贴水收敛甚至为升水状态，本基金将配置较高比例的股票资产；反之，将适当降低股票资产的比例配置，以降低股指期货贴水对投资收益产生的负面影响。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期银行定期存款基准利率（税后）
风险收益特征	本基金为特殊的灵活配置混合型发起式基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此，预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金和一般的混合型基金。

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	交通银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张騅	陆志俊
	联系电话	021-26010886	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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dbfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
本期已实现收益	-407,622.48	607,489.66
本期利润	-113,600.45	-149,725.30
加权平均基金份 额本期利润	-0.0053	-0.0032
本期加权平均净 值利润率	-0.58%	-0.36%
本期基金份额净 值增长率	-0.68%	-0.81%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	-2,877,019.60	-2,232,647.37
期末可供分配基金份额利润	-0.1361	-0.1434
期末基金资产净值	19,212,628.57	14,033,219.66
期末基金份额净值	0.9088	0.9013
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-9.12%	-9.87%

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

德邦量化对冲混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.58%	0.12%	0.12%	0.00%	0.46%	0.12%
过去三个月	0.42%	0.23%	0.37%	0.00%	0.05%	0.23%
过去六个月	-0.68%	0.20%	0.75%	0.01%	-1.43%	0.19%
过去一年	1.15%	0.26%	1.51%	0.00%	-0.36%	0.26%
过去三年	-9.39%	0.35%	4.60%	0.00%	-	0.35%
					13.99%	
自基金合同生效起至今	-9.12%	0.34%	4.87%	0.00%	-	0.34%
					13.99%	

德邦量化对冲混合 C

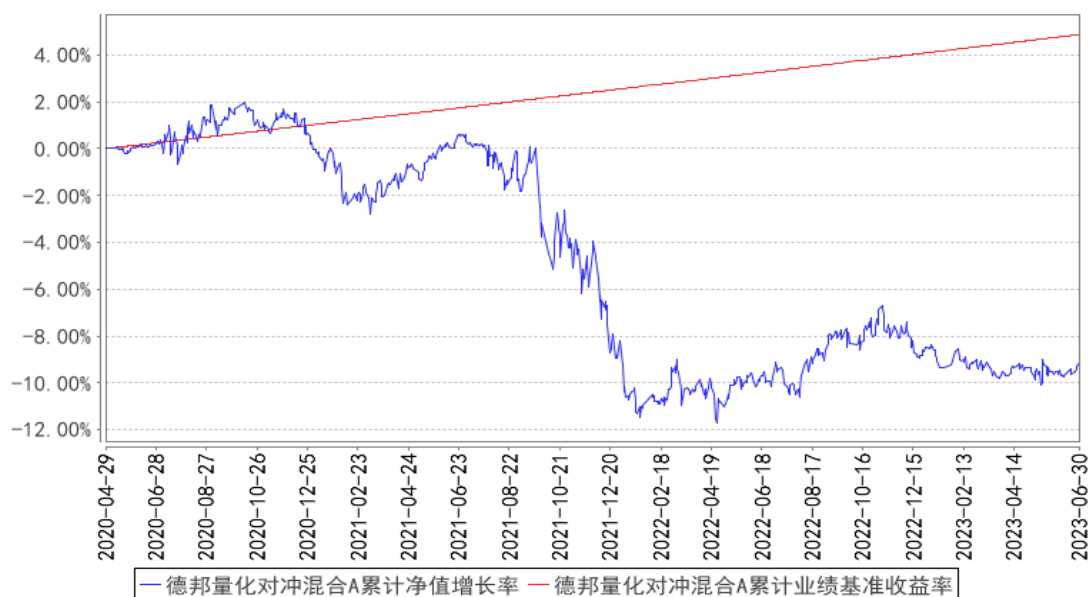
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	0.55%	0.12%	0.12%	0.00%	0.43%	0.12%
过去三个月	0.36%	0.23%	0.37%	0.00%	-0.01%	0.23%
过去六个月	-0.81%	0.20%	0.75%	0.01%	-1.56%	0.19%
过去一年	0.87%	0.26%	1.51%	0.00%	-0.64%	0.26%
过去三年	-10.09%	0.35%	4.60%	0.00%	-	0.35%
					14.69%	
自基金合同生效 起至今	-9.87%	0.34%	4.87%	0.00%	-	0.34%
					14.74%	

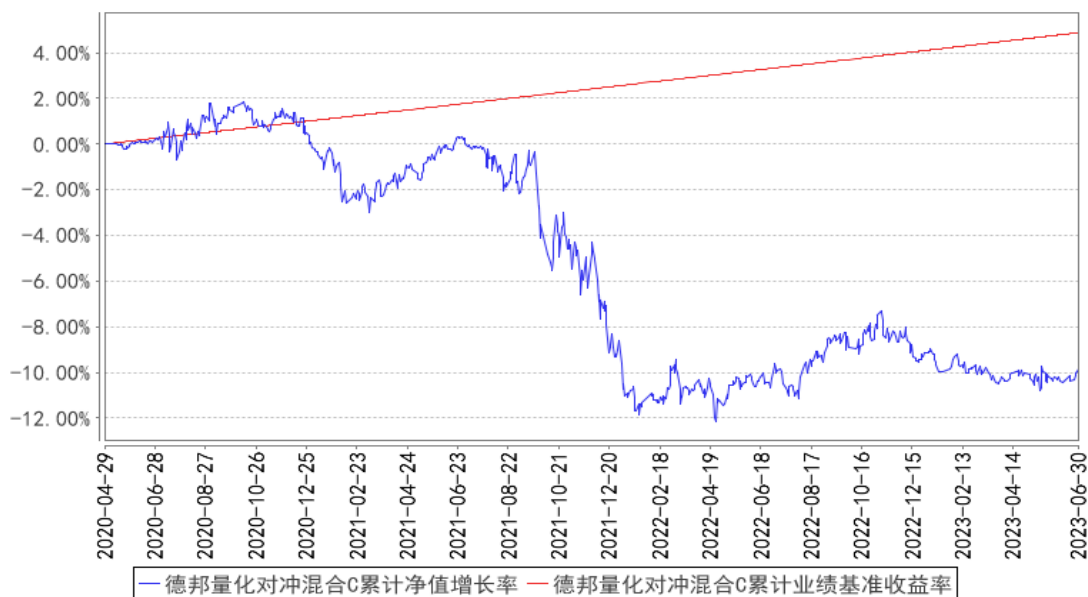
注：本基金的业绩比较基准：中国人民银行公布的同期一年期银行定期存款基准利率（税后）

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

德邦量化对冲混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



德邦量化对冲混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2020 年 04 月 29 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2020 年 04 月 29 日至 2023 年 06 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理三十二只开放式基金：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦民裕进取量化精选灵活配置混合型证券投资基金、德邦乐享生活混合型证券投资基金、德邦新添利债券型证券投资基金、德邦锐兴债券型证券投资基金、德邦景颐债券型证券投资基金、德邦锐乾债券型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、德邦如意货币市场基金、德邦锐泓债券型证券投资基金、德邦短债债券型证券投资基金、德邦德瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、德

邦锐恒 39 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、德邦大消费混合型证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金、德邦锐泽 86 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、德邦沪港深龙头混合型证券投资基金、德邦锐裕利率债债券型证券投资基金、德邦安顺混合型证券投资基金、德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金、德邦价值优选混合型证券投资基金、德邦周期精选混合型发起式证券投资基金、德邦半导体产业混合型发起式证券投资基金、德邦港股通成长精选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴志鹏	本基金的基金经理	2021 年 6 月 29 日	-	7 年	硕士，于 2016 年 4 月加入德邦基金管理有限公司，历任投资三部（量化）研究员，专户投资部投资经理，量化投资部研究员。现任德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦民裕进取量化精选灵活配置混合型证券投资基金、德邦景颐债券型证券投资基金、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金、德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金、德邦周期精选混合型发起式证券投资基金的基金经理。
李荣兴	本基金的基金经理	2022 年 6 月 17 日	-	12 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

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

股指期货方面，目前各主流期指的基差基本处于小幅贴水，对冲成本较低，本基金维持偏乐观的仓位以应对。

在投资管理上，本基金严格监控各项风险暴露，控制个股风险，模型运行比较平稳，在中证 800 和中证 1000 的成分股内结合海量因子驱动的人工智能模型、以基本面为驱动的多因子选股模型，把握优质个股的投资机会，积极获取超额收益率。报告期内，本基金使用股指期货 CTA 策略选择不同对冲品种，以获得绝对收益。

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对冲混合 A 基金份额净值为 0.9088 元，基金份额净值增长率为-0.68%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%；德邦量化对冲混合 C 基金份额净值为 0.9013 元，基金份额净值增长率为-0.81%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

股指期货方面，目前各主流期指的基差基本处于小幅贴水，对冲成本较低，本基金维持偏乐观的仓位以应对。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内出现连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形，截至本报告期末，本基金的基金资产净值仍低于五千万元。

§ 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，基金托管人在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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，德邦基金管理有限公司在德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,055,567.52	5,199,702.70
结算备付金		3,830,956.74	1,738,174.68
存出保证金		2,896,248.88	1,791,854.13
交易性金融资产	6.4.7.2	24,948,151.27	13,104,607.45
其中：股票投资		24,948,151.27	13,086,929.21

基金投资		-	-
债券投资		-	17,678.24
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		63,511.70	-
应收股利		-	-
应收申购款		80,210.00	7,850.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		33,874,646.11	21,842,189.38
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2023年6月30日	2022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		105,896.30	1,621,712.41
应付赎回款		299,038.91	31,814.53
应付管理人报酬		28,998.33	17,075.96
应付托管费		5,799.68	3,415.21
应付销售服务费		3,193.00	875.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,338.82	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	180,532.84	61,224.20
负债合计		628,797.88	1,736,117.55
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	36,709,051.23	22,005,105.25
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-3,463,203.00	-1,899,033.42
净资产合计		33,245,848.23	20,106,071.83
负债和净资产总计		33,874,646.11	21,842,189.38

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，德邦量化对冲混合 A 基金份额净值 0.9088 元，基金份额总额 21,139,776.05 份；德邦量化对冲混合 C 基金份额净值 0.9013 元，基金份额总额 15,569,275.18 份。德邦量化对冲混合份额总额合计 36,709,051.23 份。

6.2 利润表

会计主体：德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		209,117.91	-292,744.49
1. 利息收入		60,465.19	41,023.34
其中：存款利息收入	6.4.7.13	60,465.19	41,023.34
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		504,039.92	-637,235.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,106,639.14	-1,816,318.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	9,393.57	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	3,191,150.16	1,080,230.59
股利收益	6.4.7.19	410,135.33	98,852.67
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	-463,192.93	302,688.43
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	107,805.73	779.09

减：二、营业总支出		472,443.66	159,661.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	315,005.81	99,506.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	63,001.19	19,901.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	54,510.90	2,307.46
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		11,549.37	8,911.16
8. 其他费用	6.4.7.23	28,376.39	29,035.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-263,325.75	-452,406.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-263,325.75	-452,406.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-263,325.75	-452,406.27

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	22,005,105.25	-	-1,899,033.42	20,106,071.83
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)	22,005,105.25	-	-1,899,033.42	20,106,071.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	14,703,945.98	-	-1,564,169.58	13,139,776.40
(一)、综合收益总额	-	-	-263,325.75	-263,325.75
(二)、本期基金份额交易产生的	14,703,945.98	-	-1,300,843.83	13,403,102.15

基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)				
其中: 1. 基金申 购款	238,579,218.59	-	-24,107,748.21	214,471,470.38
2. 基金赎 回款	- 223,875,272.61	-	22,806,904.38	-201,068,368.23
(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)	36,709,051.23	-	-3,463,203.00	33,245,848.23
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产(基金净值)	23,081,727.56	-	-1,902,971.63	21,178,755.93
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)	23,081,727.56	-	-1,902,971.63	21,178,755.93
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-1,598,538.07	-	-286,716.68	-1,885,254.75
(一)、综合收益 总额	-	-	-452,406.27	-452,406.27
(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)	-1,598,538.07	-	165,689.59	-1,432,848.48
其中: 1. 基金申 购款	442,219.75	-	-46,513.74	395,706.01

2. 基金赎回款	-2,040,757.82	-	212,203.33	-1,828,554.49
(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)	21,483,189.49	-	-2,189,688.31	19,293,501.18

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：

<u>张騅</u>	<u>洪双龙</u>	<u>洪双龙</u>
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

德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2890 号文《关于准予德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人德邦基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2020 年 4 月 29 日生效。首次设立时募集规模为 191,956,539.03 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。

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）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股票期权、股指期货、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。

本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期一年期银行定期存款基准利率（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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规

定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,055,567.52

等于：本金	2,055,460.35
加：应计利息	107.17
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	2,055,567.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	25,447,328.05	-	24,948,151.27	-499,176.78
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	25,447,328.05	-	24,948,151.27	-499,176.78

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 2023 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	-23,536,473.78	-	-	-

生工具				
其中： 股指期货 投资	-23,536,473.78	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	-23,536,473.78	-	-	-

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
IF2309	IF2309	-8.00	-9,213,600.00	-60,624.00
IM2307	IM2307	-2.00	-2,629,920.00	-9,782.22
IM2309	IM2309	-9.00	-11,765,520.00	-2,160.00
合计				-72,566.22
减：可抵销期货 暂收款				-72,566.22
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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	73.74
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	161,082.71
其中：交易所市场	161,082.71
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	14,876.39
应付账户维护费	4,500.00
合计	180,532.84

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

德邦量化对冲混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,469,286.43	17,469,286.43
本期申购	13,604,728.82	13,604,728.82
本期赎回（以“-”号填列）	-9,934,239.20	-9,934,239.20
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	21,139,776.05	21,139,776.05

德邦量化对冲混合 C

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,535,818.82	4,535,818.82
本期申购	224,974,489.77	224,974,489.77
本期赎回 (以“-”号填列)	-213,941,033.41	-213,941,033.41
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	15,569,275.18	15,569,275.18

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

德邦量化对冲混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,029,313.83	544,226.30	-1,485,087.53
本期利润	-407,622.48	294,022.03	-113,600.45
本期基金份额交易产生的变动数	-440,083.29	111,623.79	-328,459.50
其中：基金申购款	-1,613,173.05	348,857.94	-1,264,315.11
基金赎回款	1,173,089.76	-237,234.15	935,855.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,877,019.60	949,872.12	-1,927,147.48

德邦量化对冲混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-554,926.43	140,980.54	-413,945.89
本期利润	607,489.66	-757,214.96	-149,725.30
本期基金份额交易产生的变动数	-2,285,210.60	1,312,826.27	-972,384.33
其中：基金申购款	-28,031,733.77	5,188,300.67	-22,843,433.10
基金赎回款	25,746,523.17	-3,875,474.40	21,871,048.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,232,647.37	696,591.85	-1,536,055.52

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,461.25

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	47,114.45
其他	889.49
合计	60,465.19

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,106,639.14
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	-3,106,639.14

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	310,807,606.31
减：卖出股票成本总额	313,342,579.58
减：交易费用	571,665.87
买卖股票差价收入	-3,106,639.14

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	16.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,376.88
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	9,393.57

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	44,708.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,300.00
减：应计利息总额	29.51
减：交易费用	1.78
买卖债券差价收入	9,376.88

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买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益买卖权证差价收入。

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	3,191,150.16

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	410,135.33
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	410,135.33

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-95,733.37
股票投资	-92,267.95
债券投资	-3,465.42
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-367,459.56
权证投资	-
期货投资	-367,459.56
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	-463,192.93

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	107,805.72
基金转换费收入	0.01

合计	107,805.73
----	------------

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费	13,500.00
合计	28,376.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
德邦基金管理有限公司（“德邦基金”）	基金管理人
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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）

德邦证券	-	-	3,467,351.21	2.40
------	---	---	--------------	------

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 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
德邦证券	3,229.34	3.86	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	315,005.81	99,506.15
其中：支付销售机构的客户维护费	89,997.86	36,649.01

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E * 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6	上年度可比期间 2022年1月1日至2022
----	------------------------	---------------------------

	月 30 日	年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	63,001.19	19,901.22

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C	合计
德邦基金	-	18,251.67	18,251.67
德邦证券	-	11,970.41	11,970.41
交通银行	-	6,342.94	6,342.94
合计	-	36,565.02	36,565.02
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C	合计
德邦基金	-	3.62	3.62
德邦证券	-	1.10	1.10
交通银行	-	114.37	114.37
合计	-	119.09	119.09

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,999,200.00	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	9,999,200.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	47.3004%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 29 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,999,200.00	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份	0.00	-

额		
报告期末持有的基金份额	9,999,200.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	51.0800%	-

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	2,055,567.52	12,461.25	4,551,838.66	4,230.50

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未发生其它关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资。（2022 年 12 月 31 日，同）

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

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投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	17,678.24
未评级	-	-
合计	-	17,678.24

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投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产

的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,055,567.52	-	-	-	-	-	2,055,567.52
结算备付金	3,830,956.74	-	-	-	-	-	3,830,956.74
存出保证金	2,896,248.88	-	-	-	-	-	2,896,248.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-24,948,151.27	24,948,151.27
应收申购款	-	-	-	-	-	80,210.00	80,210.00
应收清算款	-	-	-	-	-	63,511.70	63,511.70
资产总计	8,782,773.14	-	-	-	-	-25,091,872.97	33,874,646.11
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	299,038.91	299,038.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,998.33	28,998.33
应付托管费	-	-	-	-	-	5,799.68	5,799.68
应付清算款	-	-	-	-	-	105,896.30	105,896.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,193.00	3,193.00
应交税费	-	-	-	-	-	5,338.82	5,338.82

其他负债	-	-	-	-	-	180,532.84	180,532.84
负债总计	-	-	-	-	-	628,797.88	628,797.88
利率敏感度缺口	8,782,773.14	-	-	-	-	-24,463,075.09	33,245,848.23
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,199,702.70	-	-	-	-	-	5,199,702.70
结算备付金	1,738,174.68	-	-	-	-	-	1,738,174.68
存出保证金	1,791,854.13	-	-	-	-	-	1,791,854.13
交易性金融资产	-	-	-	-	17,678.24	13,086,929.21	13,104,607.45
应收申购款	-	-	-	-	-	7,850.42	7,850.42
资产总计	8,729,731.51	-	-	-	17,678.24	13,094,779.63	21,842,189.38
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	31,814.53	31,814.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,075.96	17,075.96
应付托管费	-	-	-	-	-	3,415.21	3,415.21
应付清算款	-	-	-	-	-	1,621,712.41	1,621,712.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	875.24	875.24
其他负债	-	-	-	-	-	61,224.20	61,224.20
负债总计	-	-	-	-	-	1,736,117.55	1,736,117.55
利率敏感度缺口	8,729,731.51	-	-	-	17,678.24	11,358,662.08	20,106,071.83

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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2022 年 12 月 31 日：持有交易性债券投资占基金资产净值比例为 0.0879%），银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	24,948,151.27	75.04	13,086,929.21	65.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	17,678.24	0.09
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	24,948,151.27	75.04	13,104,607.45	65.18

注：本基金权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占基金资产净值比例范围 0%-10%。本基金投资于银行存款和同业存单的比例合计不超过基金资产的 20%。每个交易日日终，本基金持有的买入期货合约和有价值证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。每个交易日日终，在扣除股指期货合约、国债期货合约及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈现线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	沪深 300 上升 1%	18,568.55	18,266.48

	沪深 300 下降 1%	-18,568.55	-18,266.48
--	--------------	------------	------------

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	24,948,151.27	13,104,607.45
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	24,948,151.27	13,104,607.45

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，

这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,948,151.27	73.65
	其中：股票	24,948,151.27	73.65
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	5,886,524.26	17.38
8	其他各项资产	3,039,970.58	8.97
9	合计	33,874,646.11	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	127,666.00	0.38
B	采矿业	995,815.00	3.00
C	制造业	15,650,770.32	47.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	847,184.00	2.55
E	建筑业	422,860.00	1.27
F	批发和零售业	671,746.00	2.02
G	交通运输、仓储和邮政业	498,579.00	1.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,121,572.05	6.38

J	金融业	2,039,559.90	6.13
K	房地产业	441,395.00	1.33
L	租赁和商务服务业	255,548.00	0.77
M	科学研究和技术服务业	223,745.00	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	13,960.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	176,544.00	0.53
R	文化、体育和娱乐业	461,207.00	1.39
S	综合	-	-
	合计	24,948,151.27	75.04

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通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601012	隆基绿能	13,400	384,178.00	1.16
2	300750	宁德时代	1,640	375,215.60	1.13
3	002600	领益智造	50,800	351,028.00	1.06
4	000858	五粮液	2,100	343,497.00	1.03
5	600519	贵州茅台	200	338,200.00	1.02
6	600329	达仁堂	7,500	336,675.00	1.01
7	603000	人民网	10,300	300,760.00	0.90
8	000630	铜陵有色	102,000	294,780.00	0.89
9	601318	中国平安	5,200	241,280.00	0.73
10	002475	立讯精密	7,400	240,130.00	0.72
11	002594	比亚迪	900	232,443.00	0.70
12	600369	西南证券	63,200	230,680.00	0.69
13	002608	江苏国信	29,000	219,530.00	0.66
14	601021	春秋航空	3,800	218,386.00	0.66
15	600331	宏达股份	45,100	213,774.00	0.64
16	601949	中国出版	17,700	208,860.00	0.63
17	688639	华恒生物	2,305	208,556.40	0.63
18	300185	通裕重工	71,400	199,206.00	0.60
19	601728	中国电信	35,200	198,176.00	0.60
20	300763	锦浪科技	1,900	197,790.00	0.59
21	002236	大华股份	9,900	195,525.00	0.59
22	601398	工商银行	40,400	194,728.00	0.59
23	600582	天地科技	33,200	193,556.00	0.58
24	601816	京沪高铁	34,400	180,944.00	0.54

25	300450	先导智能	5,000	180,850.00	0.54
26	688100	威胜信息	6,011	179,187.91	0.54
27	002027	分众传媒	26,200	178,422.00	0.54
28	301239	普瑞眼科	1,800	176,544.00	0.53
29	688148	芳源股份	14,400	175,680.00	0.53
30	600363	联创光电	4,700	174,370.00	0.52
31	300762	上海瀚讯	14,200	167,134.00	0.50
32	000100	TCL 科技	42,000	165,480.00	0.50
33	300146	汤臣倍健	6,900	165,462.00	0.50
34	002867	周大生	9,200	163,576.00	0.49
35	002085	万丰奥威	23,600	163,548.00	0.49
36	002028	思源电气	3,500	163,520.00	0.49
37	600871	石化油服	82,000	162,360.00	0.49
38	688561	奇安信	3,100	160,611.00	0.48
39	600309	万华化学	1,800	158,112.00	0.48
40	600729	重庆百货	4,900	154,056.00	0.46
41	300832	新产业	2,600	153,400.00	0.46
42	601162	天风证券	51,400	153,172.00	0.46
43	688188	柏楚电子	800	150,848.00	0.45
44	000818	航锦科技	4,500	150,165.00	0.45
45	002152	广电运通	12,700	148,844.00	0.45
46	000001	平安银行	13,200	148,236.00	0.45
47	603599	广信股份	5,300	143,524.00	0.43
48	600129	太极集团	2,400	142,776.00	0.43
49	300759	康龙化成	3,700	141,636.00	0.43
50	002252	上海莱士	18,200	136,682.00	0.41
51	002505	鹏都农牧	71,800	135,702.00	0.41
52	003816	中国广核	43,600	135,596.00	0.41
53	300122	智飞生物	3,050	134,810.00	0.41
54	300738	奥飞数据	13,200	134,640.00	0.40
55	300896	爱美客	300	133,485.00	0.40
56	601668	中国建筑	23,200	133,168.00	0.40
57	600909	华安证券	28,450	132,861.50	0.40
58	300866	安克创新	1,500	131,250.00	0.39
59	300723	一品红	4,450	130,385.00	0.39
60	000598	兴蓉环境	23,900	129,777.00	0.39
61	000426	兴业银锡	14,500	128,760.00	0.39
62	601989	中国重工	26,400	127,248.00	0.38
63	688012	中微公司	800	125,160.00	0.38
64	000338	潍柴动力	9,700	120,862.00	0.36
65	300633	开立医疗	2,200	119,900.00	0.36
66	002847	盐津铺子	1,400	119,070.00	0.36
67	002698	博实股份	6,800	118,932.00	0.36

68	300487	蓝晓科技	1,900	118,598.00	0.36
69	300856	科思股份	1,500	118,155.00	0.36
70	688390	固德威	703	117,302.58	0.35
71	601288	农业银行	32,900	116,137.00	0.35
72	603826	坤彩科技	2,300	115,000.00	0.35
73	603466	风语筑	8,200	113,980.00	0.34
74	300418	昆仑万维	2,800	112,784.00	0.34
75	688617	惠泰医疗	300	112,125.00	0.34
76	688277	天智航	6,078	112,078.32	0.34
77	603920	世运电路	5,700	111,321.00	0.33
78	601088	中国神华	3,600	110,700.00	0.33
79	002318	久立特材	6,400	108,992.00	0.33
80	000568	泸州老窖	500	104,785.00	0.32
81	301015	百洋医药	3,700	102,712.00	0.31
82	603032	德新科技	2,960	102,238.40	0.31
83	601009	南京银行	12,600	100,800.00	0.30
84	000851	高鸿股份	18,500	100,640.00	0.30
85	002038	双鹭药业	9,900	99,891.00	0.30
86	600039	四川路桥	10,100	99,081.00	0.30
87	600508	上海能源	6,700	98,356.00	0.30
88	001914	招商积余	6,500	97,825.00	0.29
89	688383	新益昌	700	97,454.00	0.29
90	688789	宏华数科	1,100	97,163.00	0.29
91	000733	振华科技	1,000	95,850.00	0.29
92	300811	铂科新材	1,600	95,104.00	0.29
93	000333	美的集团	1,600	94,272.00	0.28
94	002088	鲁阳节能	5,100	94,044.00	0.28
95	300144	宋城演艺	7,400	91,760.00	0.28
96	600335	国机汽车	8,000	91,200.00	0.27
97	600886	国投电力	7,100	89,815.00	0.27
98	301029	怡合达	2,000	89,360.00	0.27
99	002465	海格通信	8,500	87,890.00	0.26
100	000651	格力电器	2,400	87,624.00	0.26
101	002422	科伦药业	2,900	86,072.00	0.26
102	002056	横店东磁	4,700	85,587.00	0.26
103	601868	中国能建	36,300	84,942.00	0.26
104	300014	亿纬锂能	1,400	84,700.00	0.25
105	000048	京基智农	4,300	83,936.00	0.25
106	002128	电投能源	6,300	83,286.00	0.25
107	688083	中望软件	560	81,138.40	0.24
108	300900	广联航空	2,800	80,668.00	0.24
109	002372	伟星新材	3,900	80,106.00	0.24
110	002714	牧原股份	1,900	80,085.00	0.24

111	300957	贝泰妮	900	79,992.00	0.24
112	601600	中国铝业	14,500	79,605.00	0.24
113	300476	胜宏科技	3,300	79,563.00	0.24
114	688027	国盾量子	500	79,160.00	0.24
115	000652	泰达股份	18,900	77,868.00	0.23
116	002991	甘源食品	1,000	76,700.00	0.23
117	300294	博雅生物	2,100	76,188.00	0.23
118	605099	共创草坪	3,400	75,922.00	0.23
119	688516	奥特维	400	75,360.00	0.23
120	600030	中信证券	3,800	75,164.00	0.23
121	002017	东信和平	5,690	74,595.90	0.22
122	688556	高测股份	1,400	74,396.00	0.22
123	601166	兴业银行	4,700	73,555.00	0.22
124	000567	海德股份	5,720	73,330.40	0.22
125	300432	富临精工	6,300	73,206.00	0.22
126	000166	申万宏源	15,800	72,996.00	0.22
127	002568	百润股份	2,000	72,700.00	0.22
128	600050	中国联通	15,100	72,480.00	0.22
129	300170	汉得信息	6,200	71,548.00	0.22
130	688499	利元亨	1,120	71,142.40	0.21
131	002544	普天科技	3,100	70,990.00	0.21
132	300271	华宇软件	6,400	70,912.00	0.21
133	300674	宇信科技	4,000	70,720.00	0.21
134	000563	陕国投 A	23,000	70,150.00	0.21
135	605499	东鹏饮料	400	69,160.00	0.21
136	600016	民生银行	18,300	68,625.00	0.21
137	600893	航发动力	1,600	67,616.00	0.20
138	603033	三维股份	3,300	67,155.00	0.20
139	600773	西藏城投	5,300	66,780.00	0.20
140	601898	中煤能源	7,900	66,676.00	0.20
141	300767	震安科技	2,600	65,936.00	0.20
142	688686	奥普特	400	65,792.00	0.20
143	600971	恒源煤电	8,300	64,657.00	0.19
144	603290	斯达半导	300	64,560.00	0.19
145	600028	中国石化	10,100	64,236.00	0.19
146	002371	北方华创	200	63,530.00	0.19
147	601886	江河集团	7,100	63,119.00	0.19
148	600246	万通发展	11,000	62,920.00	0.19
149	000517	荣安地产	20,600	62,830.00	0.19
150	600036	招商银行	1,900	62,244.00	0.19
151	600728	佳都科技	8,900	61,677.00	0.19
152	000878	云南铜业	5,500	60,775.00	0.18
153	002929	润建股份	1,400	60,774.00	0.18

154	688281	华秦科技	300	60,750.00	0.18
155	600027	华电国际	9,000	60,210.00	0.18
156	000708	中信特钢	3,800	60,192.00	0.18
157	600879	航天电子	7,000	59,430.00	0.18
158	002179	中航光电	1,300	58,955.00	0.18
159	000423	东阿阿胶	1,100	58,795.00	0.18
160	605589	圣泉集团	2,700	58,698.00	0.18
161	002130	沃尔核材	7,200	58,464.00	0.18
162	603605	珀莱雅	520	58,448.00	0.18
163	601058	赛轮轮胎	5,100	58,089.00	0.17
164	603328	依顿电子	7,000	57,960.00	0.17
165	601168	西部矿业	5,500	57,805.00	0.17
166	603195	公牛集团	600	57,636.00	0.17
167	600570	恒生电子	1,300	57,577.00	0.17
168	002063	远光软件	6,517	56,567.56	0.17
169	605333	沪光股份	3,400	56,236.00	0.17
170	300628	亿联网络	1,600	56,112.00	0.17
171	002466	天齐锂业	800	55,928.00	0.17
172	600845	宝信软件	1,100	55,891.00	0.17
173	002563	森马服饰	8,900	55,358.00	0.17
174	688082	盛美上海	500	55,200.00	0.17
175	000415	渤海租赁	26,200	55,020.00	0.17
176	300751	迈为股份	320	54,201.60	0.16
177	300382	斯莱克	4,100	54,079.00	0.16
178	603105	芯能科技	3,200	54,048.00	0.16
179	600968	海油发展	17,600	54,032.00	0.16
180	601198	东兴证券	6,700	53,734.00	0.16
181	600635	大众公用	15,900	52,788.00	0.16
182	002595	豪迈科技	1,500	52,695.00	0.16
183	000408	藏格矿业	2,300	51,911.00	0.16
184	688559	海目星	1,100	51,711.00	0.16
185	000935	四川双马	3,000	50,520.00	0.15
186	688315	诺禾致源	1,900	50,445.00	0.15
187	600399	抚顺特钢	4,900	49,980.00	0.15
188	601212	白银有色	18,100	49,232.00	0.15
189	002782	可立克	3,200	48,928.00	0.15
190	601608	中信重工	11,600	48,836.00	0.15
191	688711	宏微科技	829	48,363.86	0.15
192	002239	奥特佳	18,100	48,327.00	0.15
193	300438	鹏辉能源	1,000	48,040.00	0.14
194	002303	美盈森	14,800	47,804.00	0.14
195	000932	华菱钢铁	10,000	47,700.00	0.14
196	688578	艾力斯	1,765	47,566.75	0.14

197	600478	科力远	6,600	47,124.00	0.14
198	002254	泰和新材	1,900	46,493.00	0.14
199	002415	海康威视	1,400	46,354.00	0.14
200	300253	卫宁健康	4,200	45,444.00	0.14
201	300474	景嘉微	500	44,995.00	0.14
202	688331	荣昌生物	800	44,600.00	0.13
203	300035	中科电气	3,700	44,474.00	0.13
204	002773	康弘药业	2,300	43,976.00	0.13
205	002314	南山控股	13,100	43,230.00	0.13
206	000761	本钢板材	10,800	43,200.00	0.13
207	600150	中国船舶	1,300	42,783.00	0.13
208	600160	巨化股份	3,100	42,718.00	0.13
209	300616	尚品宅配	2,100	42,588.00	0.13
210	603959	百利科技	3,700	42,550.00	0.13
211	603871	嘉友国际	2,700	42,417.00	0.13
212	002050	三花智控	1,400	42,364.00	0.13
213	300498	温氏股份	2,300	42,205.00	0.13
214	002946	新乳业	2,900	41,615.00	0.13
215	300229	拓尔思	1,600	41,552.00	0.12
216	300455	航天智装	3,600	41,220.00	0.12
217	300205	天喻信息	2,900	40,687.00	0.12
218	300607	拓斯达	2,700	40,581.00	0.12
219	300872	天阳科技	2,600	40,404.00	0.12
220	600578	京能电力	10,300	40,273.00	0.12
221	603899	晨光股份	900	40,176.00	0.12
222	600900	长江电力	1,800	39,708.00	0.12
223	300142	沃森生物	1,500	39,675.00	0.12
224	688063	派能科技	200	39,650.00	0.12
225	300860	锋尚文化	700	38,808.00	0.12
226	002838	道恩股份	2,300	38,640.00	0.12
227	000566	海南海药	7,700	38,500.00	0.12
228	000811	冰轮环境	2,400	37,824.00	0.11
229	603393	新天然气	1,400	37,576.00	0.11
230	000031	大悦城	10,200	37,332.00	0.11
231	002421	达实智能	10,600	37,312.00	0.11
232	301089	拓新药业	600	37,164.00	0.11
233	001979	招商蛇口	2,800	36,484.00	0.11
234	688676	金盘科技	1,200	36,348.00	0.11
235	003006	百亚股份	2,100	36,288.00	0.11
236	002683	广东宏大	1,200	35,328.00	0.11
237	601988	中国银行	8,900	34,799.00	0.10
238	300395	菲利华	700	34,440.00	0.10
239	600131	国网信通	1,700	34,323.00	0.10

240	600562	国睿科技	2,100	34,020.00	0.10
241	600863	内蒙华电	7,900	32,785.00	0.10
242	601106	中国一重	9,600	32,256.00	0.10
243	688568	中科星图	400	32,232.00	0.10
244	601899	紫金矿业	2,800	31,836.00	0.10
245	300887	谱尼测试	800	31,664.00	0.10
246	603979	金诚信	1,000	31,100.00	0.09
247	601997	贵阳银行	5,900	30,444.00	0.09
248	300888	稳健医疗	700	29,169.00	0.09
249	600531	豫光金铅	4,500	28,350.00	0.09
250	000725	京东方 A	6,900	28,221.00	0.08
251	002736	国信证券	3,200	27,936.00	0.08
252	300059	东方财富	1,900	26,980.00	0.08
253	000002	万 科 A	1,900	26,638.00	0.08
254	002068	黑猫股份	2,200	26,114.00	0.08
255	000625	长安汽车	2,000	25,860.00	0.08
256	002990	盛视科技	700	25,760.00	0.08
257	603093	南华期货	2,300	25,047.00	0.08
258	600993	马应龙	900	25,029.00	0.08
259	300102	乾照光电	3,800	25,004.00	0.08
260	300855	图南股份	700	24,724.00	0.07
261	300145	中金环境	8,200	24,108.00	0.07
262	002648	卫星化学	1,600	23,936.00	0.07
263	688262	国芯科技	561	22,827.09	0.07
264	600009	上海机场	500	22,710.00	0.07
265	002747	埃斯顿	800	22,400.00	0.07
266	601888	中国中免	200	22,106.00	0.07
267	002812	恩捷股份	200	19,270.00	0.06
268	688330	宏力达	420	14,733.60	0.04
269	300355	蒙草生态	4,000	13,960.00	0.04
270	301171	易点天下	600	13,260.00	0.04
271	688158	优刻得	700	13,216.00	0.04
272	300861	美畅股份	300	13,011.00	0.04
273	688425	铁建重工	2,700	12,987.00	0.04
274	002384	东山精密	500	12,950.00	0.04
275	002324	普利特	900	12,843.00	0.04
276	601975	招商南油	4,400	12,584.00	0.04
277	000559	万向钱潮	2,300	12,535.00	0.04
278	600370	三房巷	4,600	12,328.00	0.04
279	300747	锐科激光	400	12,192.00	0.04
280	000682	东方电子	1,200	11,664.00	0.04
281	601528	瑞丰银行	2,300	11,155.00	0.03
282	300203	聚光科技	500	10,135.00	0.03

283	002891	中宠股份	400	9,656.00	0.03
284	000503	国新健康	800	9,592.00	0.03
285	600297	广汇汽车	4,600	9,568.00	0.03
286	601169	北京银行	2,000	9,260.00	0.03
287	000690	宝新能源	1,300	9,126.00	0.03
288	605365	立达信	600	8,988.00	0.03
289	002006	精工科技	400	8,628.00	0.03
290	002928	华夏航空	1,000	8,450.00	0.03
291	002463	沪电股份	400	8,376.00	0.03
292	601006	大秦铁路	1,100	8,173.00	0.02
293	300133	华策影视	1,100	7,799.00	0.02
294	688128	中国电研	300	7,650.00	0.02
295	603185	弘元绿能	100	7,455.00	0.02
296	300953	震裕科技	100	7,363.00	0.02
297	600225	卓朗科技	1,200	7,356.00	0.02
298	003012	东鹏控股	900	7,281.00	0.02
299	688127	蓝特光学	400	7,052.00	0.02
300	600612	老凤祥	100	6,988.00	0.02
301	002192	融捷股份	100	6,683.00	0.02
302	002020	京新药业	500	6,410.00	0.02
303	605376	博迁新材	200	6,276.00	0.02
304	601555	东吴证券	900	6,246.00	0.02
305	002233	塔牌集团	800	6,176.00	0.02
306	600996	贵广网络	600	5,892.00	0.02
307	600742	一汽富维	700	5,733.00	0.02
308	000969	安泰科技	600	5,682.00	0.02
309	001696	宗申动力	800	5,664.00	0.02
310	600572	康恩贝	800	5,480.00	0.02
311	601118	海南橡胶	1,200	5,376.00	0.02
312	300497	富祥药业	400	5,104.00	0.02
313	603355	莱克电气	200	5,082.00	0.02
314	600377	宁沪高速	500	4,915.00	0.01
315	002003	伟星股份	500	4,680.00	0.01
316	603170	宝立食品	200	4,252.00	0.01
317	002139	拓邦股份	200	2,610.00	0.01

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	002371	北方华创	3,036,917.72	15.10
2	000725	京东方 A	2,582,378.00	12.84
3	300750	宁德时代	2,301,085.00	11.44

4	688111	金山办公	2,277,489.97	11.33
5	000540	*ST 中天	2,069,186.00	10.29
6	603613	国联股份	2,052,900.00	10.21
7	000858	五粮液	2,048,770.00	10.19
8	300896	爱美客	2,016,679.00	10.03
9	300058	蓝色光标	1,983,375.00	9.86
10	300763	锦浪科技	1,918,046.00	9.54
11	000568	泸州老窖	1,917,413.00	9.54
12	603605	珀莱雅	1,828,161.00	9.09
13	688390	固德威	1,795,756.23	8.93
14	601318	中国平安	1,779,395.00	8.85
15	002292	奥飞娱乐	1,697,361.00	8.44
16	688063	派能科技	1,693,612.35	8.42
17	002600	领益智造	1,691,367.00	8.41
18	300024	机器人	1,682,671.00	8.37
19	601728	中国电信	1,670,067.00	8.31
20	002422	科伦药业	1,665,437.00	8.28
21	688012	中微公司	1,662,800.84	8.27
22	000818	航锦科技	1,659,377.00	8.25
23	300033	同花顺	1,641,837.00	8.17
24	002463	沪电股份	1,625,283.60	8.08
25	300832	新产业	1,614,164.00	8.03
26	000651	格力电器	1,576,395.00	7.84
27	002594	比亚迪	1,572,167.00	7.82
28	300860	锋尚文化	1,554,726.00	7.73
29	002466	天齐锂业	1,523,109.00	7.58
30	601333	广深铁路	1,503,419.00	7.48
31	000100	TCL 科技	1,463,835.00	7.28
32	000988	华工科技	1,458,955.00	7.26
33	300130	新国都	1,458,867.00	7.26
34	601816	京沪高铁	1,392,779.00	6.93
35	003021	兆威机电	1,388,113.00	6.90
36	601012	隆基绿能	1,363,592.00	6.78
37	002352	顺丰控股	1,338,968.00	6.66
38	688188	柏楚电子	1,306,849.52	6.50
39	601929	吉视传媒	1,306,744.00	6.50
40	300059	东方财富	1,302,659.00	6.48
41	002236	大华股份	1,292,761.00	6.43
42	688202	美迪西	1,269,681.75	6.31
43	300474	景嘉微	1,260,506.00	6.27
44	300014	亿纬锂能	1,251,342.00	6.22
45	601398	工商银行	1,234,812.00	6.14
46	300390	天华新能	1,229,206.00	6.11

47	300762	上海瀚讯	1,200,349.84	5.97
48	603379	三美股份	1,199,086.00	5.96
49	002368	太极股份	1,197,520.32	5.96
50	600369	西南证券	1,189,687.00	5.92
51	002738	中矿资源	1,175,786.00	5.85
52	300765	新诺威	1,170,113.94	5.82
53	600016	民生银行	1,162,747.00	5.78
54	300115	长盈精密	1,160,626.00	5.77
55	605499	东鹏饮料	1,152,959.00	5.73
56	000425	徐工机械	1,145,151.00	5.70
57	688100	威胜信息	1,136,602.67	5.65
58	300170	汉得信息	1,136,581.00	5.65
59	601997	贵阳银行	1,136,174.00	5.65
60	601958	金钼股份	1,133,931.00	5.64
61	600996	贵广网络	1,123,513.00	5.59
62	002421	达实智能	1,109,116.00	5.52
63	003035	南网能源	1,106,884.00	5.51
64	002217	合力泰	1,088,323.00	5.41
65	300394	天孚通信	1,071,448.00	5.33
66	688321	微芯生物	1,066,189.43	5.30
67	002459	晶澳科技	1,059,892.00	5.27
68	600871	石化油服	1,052,639.00	5.24
69	600519	贵州茅台	1,049,243.00	5.22
70	600246	万通发展	1,040,805.00	5.18
71	688127	蓝特光学	1,035,582.70	5.15
72	300251	光线传媒	1,030,034.00	5.12
73	601989	中国重工	1,014,266.00	5.04
74	003816	中国广核	1,012,039.00	5.03
75	601288	农业银行	1,006,399.00	5.01
76	605117	德业股份	1,001,153.00	4.98
77	601628	中国人寿	996,278.00	4.96
78	002027	分众传媒	992,280.00	4.94
79	002460	赣锋锂业	990,904.04	4.93
80	000563	陕国投 A	989,963.00	4.92
81	300229	拓尔思	970,573.00	4.83
82	300054	鼎龙股份	970,393.00	4.83
83	002017	东信和平	960,715.00	4.78
84	002291	遥望科技	956,404.00	4.76
85	300455	航天智装	951,687.00	4.73
86	601162	天风证券	944,477.00	4.70
87	002475	立讯精密	938,290.00	4.67
88	600050	中国联通	929,736.00	4.62
89	300476	胜宏科技	924,937.00	4.60

90	600901	江苏金租	923,334.00	4.59
91	601231	环旭电子	922,863.00	4.59
92	000021	深科技	916,483.00	4.56
93	300900	广联航空	916,359.00	4.56
94	688617	惠泰医疗	915,463.00	4.55
95	300357	我武生物	913,049.00	4.54
96	688639	华恒生物	911,992.17	4.54
97	300634	彩讯股份	899,969.00	4.48
98	002085	万丰奥威	877,519.00	4.36
99	000598	兴蓉环境	873,343.00	4.34
100	300363	博腾股份	866,242.00	4.31
101	603000	人民网	865,548.00	4.30
102	002741	光华科技	864,392.00	4.30
103	300628	亿联网络	857,598.00	4.27
104	002063	远光软件	856,397.98	4.26
105	002803	吉宏股份	847,304.00	4.21
106	300751	迈为股份	847,268.00	4.21
107	000048	京基智农	841,082.00	4.18
108	600959	江苏有线	825,813.00	4.11
109	600223	福瑞达	825,463.00	4.11
110	688001	华兴源创	823,246.95	4.09
111	300001	特锐德	821,270.00	4.08
112	688116	天奈科技	819,689.15	4.08
113	600415	小商品城	817,342.00	4.07
114	002351	漫步者	811,773.00	4.04
115	002088	鲁阳节能	811,468.00	4.04
116	002979	雷赛智能	810,383.00	4.03
117	600928	西安银行	809,913.00	4.03
118	688330	宏力达	807,219.72	4.01
119	300133	华策影视	806,440.00	4.01
120	300253	卫宁健康	795,595.00	3.96
121	688777	中控技术	787,963.07	3.92
122	600547	山东黄金	787,836.00	3.92
123	688578	艾力斯	777,535.84	3.87
124	000690	宝新能源	771,143.50	3.84
125	002409	雅克科技	769,555.00	3.83
126	600900	长江电力	766,666.00	3.81
127	000937	冀中能源	764,576.00	3.80
128	688700	东威科技	761,892.08	3.79
129	688981	中芯国际	753,660.64	3.75
130	300856	科思股份	751,981.00	3.74
131	002867	周大生	750,401.00	3.73
132	002276	万马股份	746,416.00	3.71

133	300274	阳光电源	739,566.00	3.68
134	000932	华菱钢铁	735,624.00	3.66
135	688586	江航装备	726,042.90	3.61
136	601988	中国银行	724,371.00	3.60
137	603599	广信股份	721,365.00	3.59
138	300212	易华录	714,735.00	3.55
139	000002	万科A	710,342.00	3.53
140	603105	芯能科技	705,478.00	3.51
141	300035	中科电气	702,048.00	3.49
142	003031	中瓷电子	701,989.00	3.49
143	300205	天喻信息	701,988.00	3.49
144	300607	拓斯达	701,572.00	3.49
145	601868	中国能建	695,804.00	3.46
146	601009	南京银行	694,817.00	3.46
147	601881	中国银河	691,807.16	3.44
148	002517	恺英网络	688,245.00	3.42
149	688521	芯原股份	684,058.48	3.40
150	000656	金科股份	679,562.00	3.38
151	601668	中国建筑	675,871.00	3.36
152	601138	工业富联	672,153.00	3.34
153	002400	省广集团	671,590.00	3.34
154	600895	张江高科	666,119.00	3.31
155	002714	牧原股份	664,584.00	3.31
156	600667	太极实业	656,922.00	3.27
157	301089	拓新药业	647,024.00	3.22
158	000961	中南建设	645,258.00	3.21
159	300655	晶瑞电材	644,515.00	3.21
160	600863	内蒙华电	643,944.00	3.20
161	002034	旺能环境	642,595.00	3.20
162	002317	众生药业	641,130.00	3.19
163	002865	钧达股份	640,222.00	3.18
164	300168	万达信息	640,063.00	3.18
165	688017	绿的谐波	639,689.06	3.18
166	300009	安科生物	632,514.00	3.15
167	603993	洛阳钼业	630,553.00	3.14
168	603108	润达医疗	630,307.00	3.13
169	000338	潍柴动力	628,139.00	3.12
170	300760	迈瑞医疗	624,967.00	3.11
171	688499	利元亨	622,157.89	3.09
172	300151	昌红科技	618,689.00	3.08
173	605507	国邦医药	617,718.00	3.07
174	601106	中国一重	617,045.00	3.07
175	002222	福晶科技	615,244.00	3.06

176	600380	健康元	608,914.00	3.03
177	688083	中望软件	604,106.42	3.00
178	002303	美盈森	604,095.00	3.00
179	000933	神火股份	602,694.00	3.00
180	300525	博思软件	596,709.00	2.97
181	002847	盐津铺子	591,823.00	2.94
182	688158	优刻得	584,543.15	2.91
183	002318	久立特材	583,024.00	2.90
184	002174	游族网络	582,933.00	2.90
185	300423	昇辉科技	581,325.00	2.89
186	601319	中国人保	578,725.00	2.88
187	300910	瑞丰新材	576,326.00	2.87
188	300661	圣邦股份	576,211.00	2.87
189	603235	天新药业	568,192.05	2.83
190	002372	伟星新材	567,003.00	2.82
191	600958	东方证券	566,799.00	2.82
192	603328	依顿电子	566,760.00	2.82
193	002065	东华软件	565,293.00	2.81
194	300723	一品红	561,082.00	2.79
195	002230	科大讯飞	559,611.00	2.78
196	688711	宏微科技	558,297.00	2.78
197	601198	东兴证券	556,489.00	2.77
198	300761	立华股份	554,895.00	2.76
199	300687	赛意信息	553,800.00	2.75
200	002683	广东宏大	553,530.00	2.75
201	688208	道通科技	547,113.04	2.72
202	688277	天智航	546,618.72	2.72
203	600909	华安证券	545,029.00	2.71
204	600089	特变电工	544,933.00	2.71
205	688800	瑞可达	543,833.52	2.70
206	688005	容百科技	542,061.10	2.70
207	300015	爱尔眼科	539,840.00	2.68
208	002252	上海莱士	539,666.00	2.68
209	002697	红旗连锁	537,891.00	2.68
210	002056	横店东磁	531,327.00	2.64
211	002838	道恩股份	531,138.00	2.64
212	300487	蓝晓科技	530,439.00	2.64
213	000001	平安银行	528,312.00	2.63
214	601899	紫金矿业	528,144.00	2.63
215	688009	中国通号	525,270.21	2.61
216	601168	西部矿业	524,660.00	2.61
217	605369	拱东医疗	523,385.00	2.60
218	002832	比音勒芬	523,145.00	2.60

219	300079	数码视讯	522,577.00	2.60
220	002415	海康威视	522,467.00	2.60
221	002215	诺普信	522,286.00	2.60
222	600331	宏达股份	522,056.00	2.60
223	300672	国科微	521,010.00	2.59
224	600742	一汽富维	520,618.00	2.59
225	688037	芯源微	519,756.64	2.59
226	301031	中熔电气	518,168.00	2.58
227	000851	高鸿股份	517,895.00	2.58
228	000676	智度股份	514,416.00	2.56
229	600971	恒源煤电	504,681.00	2.51
230	300567	精测电子	502,704.00	2.50
231	600039	四川路桥	499,112.00	2.48
232	601077	渝农商行	497,466.00	2.47
233	600329	达仁堂	496,770.00	2.47
234	601212	白银有色	491,910.00	2.45
235	600036	招商银行	491,406.00	2.44
236	000426	兴业银锡	491,276.00	2.44
237	002049	紫光国微	490,718.00	2.44
238	688686	奥普特	490,449.32	2.44
239	002020	京新药业	490,043.00	2.44
240	600775	南京熊猫	488,979.00	2.43
241	688088	虹软科技	488,152.23	2.43
242	300101	振芯科技	482,985.00	2.40
243	603826	坤彩科技	482,714.00	2.40
244	600188	兖矿能源	480,723.00	2.39
245	600845	宝信软件	479,855.00	2.39
246	002156	通富微电	479,261.00	2.38
247	688680	海优新材	478,697.53	2.38
248	002015	协鑫能科	471,425.00	2.34
249	300382	斯莱克	470,670.00	2.34
250	601992	金隅集团	465,047.00	2.31
251	600160	巨化股份	464,980.00	2.31
252	688256	寒武纪	458,418.80	2.28
253	603612	索通发展	455,327.00	2.26
254	002777	久远银海	455,254.00	2.26
255	000652	泰达股份	454,374.00	2.26
256	301029	怡合达	451,769.00	2.25
257	000423	东阿阿胶	448,507.00	2.23
258	002993	奥海科技	445,892.00	2.22
259	600030	中信证券	444,335.00	2.21
260	300666	江丰电子	443,243.00	2.20
261	601799	星宇股份	439,951.00	2.19

262	300502	新易盛	439,916.00	2.19
263	000682	东方电子	438,772.00	2.18
264	000938	紫光股份	438,514.00	2.18
265	300203	聚光科技	434,393.00	2.16
266	300653	正海生物	434,369.00	2.16
267	300456	赛微电子	434,052.00	2.16
268	300149	睿智医药	433,504.00	2.16
269	300395	菲利华	431,900.00	2.15
270	600562	国睿科技	429,870.00	2.14
271	300684	中石科技	429,809.00	2.14
272	600131	国网信通	429,105.00	2.13
273	002176	江特电机	428,413.00	2.13
274	600582	天地科技	427,251.00	2.12
275	300428	立中集团	425,346.00	2.12
276	300872	天阳科技	424,741.00	2.11
277	605589	圣泉集团	423,214.00	2.10
278	600705	中航产融	423,004.00	2.10
279	601179	中国西电	421,711.00	2.10
280	605099	共创草坪	420,807.00	2.09
281	603056	德邦股份	420,567.00	2.09
282	601186	中国铁建	413,813.00	2.06
283	002649	博彦科技	409,829.00	2.04
284	600886	国投电力	408,374.00	2.03
285	688268	华特气体	408,277.30	2.03
286	601857	中国石油	404,496.00	2.01
287	002194	武汉凡谷	403,751.00	2.01
288	000567	海德股份	402,204.00	2.00

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	002371	北方华创	3,206,737.00	15.95
2	000725	京东方 A	2,397,043.00	11.92
3	688111	金山办公	2,390,406.26	11.89
4	300750	宁德时代	2,374,162.28	11.81
5	300058	蓝色光标	2,184,182.00	10.86
6	603613	国联股份	1,907,717.24	9.49
7	002292	奥飞娱乐	1,821,447.00	9.06
8	300033	同花顺	1,811,363.00	9.01
9	300896	爱美客	1,798,250.00	8.94
10	300024	机器人	1,798,110.00	8.94
11	002422	科伦药业	1,770,778.00	8.81

12	000568	泸州老窖	1,770,426.00	8.81
13	002466	天齐锂业	1,710,339.00	8.51
14	603605	珀莱雅	1,708,556.00	8.50
15	002463	沪电股份	1,701,748.50	8.46
16	300763	锦浪科技	1,672,758.00	8.32
17	601318	中国平安	1,669,184.00	8.30
18	000858	五粮液	1,663,957.00	8.28
19	688390	固德威	1,640,954.45	8.16
20	601333	广深铁路	1,637,865.00	8.15
21	688063	派能科技	1,607,743.90	8.00
22	002594	比亚迪	1,539,194.00	7.66
23	688012	中微公司	1,520,164.97	7.56
24	000818	航锦科技	1,494,659.00	7.43
25	601728	中国电信	1,490,720.00	7.41
26	000988	华工科技	1,483,396.00	7.38
27	300130	新国都	1,477,820.00	7.35
28	300860	锋尚文化	1,473,310.00	7.33
29	300059	东方财富	1,458,101.20	7.25
30	603379	三美股份	1,452,353.00	7.22
31	003021	兆威机电	1,447,971.36	7.20
32	300832	新产业	1,439,859.00	7.16
33	000651	格力电器	1,395,718.00	6.94
34	300765	新诺威	1,385,755.40	6.89
35	002738	中矿资源	1,342,582.00	6.68
36	002600	领益智造	1,331,293.00	6.62
37	002368	太极股份	1,307,843.00	6.50
38	601929	吉视传媒	1,306,372.00	6.50
39	688202	美迪西	1,301,637.77	6.47
40	601398	工商银行	1,297,153.00	6.45
41	002352	顺丰控股	1,286,353.00	6.40
42	601816	京沪高铁	1,262,439.00	6.28
43	300014	亿纬锂能	1,244,533.00	6.19
44	000100	TCL 科技	1,203,091.10	5.98
45	601628	中国人寿	1,189,700.00	5.92
46	601997	贵阳银行	1,187,006.00	5.90
47	688188	柏楚电子	1,163,847.61	5.79
48	002236	大华股份	1,139,439.00	5.67
49	300115	长盈精密	1,130,829.00	5.62
50	605117	德业股份	1,130,178.00	5.62
51	300390	天华新能	1,122,478.10	5.58
52	300474	景嘉微	1,118,407.00	5.56
53	000425	徐工机械	1,109,700.00	5.52
54	002217	合力泰	1,107,200.00	5.51

55	300229	拓尔思	1,093,630.00	5.44
56	300251	光线传媒	1,089,476.00	5.42
57	002291	遥望科技	1,087,411.00	5.41
58	600996	贵广网络	1,073,144.00	5.34
59	601958	金钼股份	1,062,025.00	5.28
60	300394	天孚通信	1,048,160.00	5.21
61	000540	*ST 中天	1,047,738.00	5.21
62	601989	中国重工	1,040,425.00	5.17
63	600901	江苏金租	1,037,263.00	5.16
64	003035	南网能源	1,032,893.95	5.14
65	600016	民生银行	1,027,667.00	5.11
66	601288	农业银行	1,024,233.00	5.09
67	605499	东鹏饮料	1,019,977.00	5.07
68	300054	鼎龙股份	1,009,311.00	5.02
69	300170	汉得信息	1,005,136.73	5.00
70	688100	威胜信息	990,799.98	4.93
71	002459	晶澳科技	978,516.40	4.87
72	002421	达实智能	976,715.00	4.86
73	000563	陕国投 A	957,687.00	4.76
74	002460	赣锋锂业	951,540.00	4.73
75	688127	蓝特光学	935,675.29	4.65
76	688617	惠泰医疗	934,859.67	4.65
77	003816	中国广核	932,783.00	4.64
78	600246	万通发展	924,578.00	4.60
79	601988	中国银行	922,182.00	4.59
80	000021	深科技	921,687.00	4.58
81	600369	西南证券	914,698.00	4.55
82	300476	胜宏科技	914,211.00	4.55
83	002017	东信和平	913,959.00	4.55
84	300634	彩讯股份	895,292.00	4.45
85	601012	隆基绿能	889,260.20	4.42
86	300455	航天智装	882,380.00	4.39
87	002351	漫步者	876,591.00	4.36
88	300133	华策影视	875,400.00	4.35
89	000690	宝新能源	868,253.50	4.32
90	600519	贵州茅台	865,353.00	4.30
91	300762	上海瀚讯	859,751.00	4.28
92	300357	我武生物	858,355.00	4.27
93	600050	中国联通	857,289.00	4.26
94	002803	吉宏股份	856,366.00	4.26
95	002979	雷赛智能	854,057.00	4.25
96	601162	天风证券	853,867.00	4.25
97	600871	石化油服	849,660.00	4.23

98	688321	微芯生物	848,164.14	4.22
99	300001	特锐德	847,315.00	4.21
100	300751	迈为股份	846,126.00	4.21
101	688981	中芯国际	844,793.65	4.20
102	002276	万马股份	833,529.00	4.15
103	000937	冀中能源	829,829.00	4.13
104	600223	福瑞达	826,618.00	4.11
105	600959	江苏有线	825,743.00	4.11
106	002027	分众传媒	823,044.00	4.09
107	600415	小商品城	815,970.00	4.06
108	002741	光华科技	809,649.00	4.03
109	300274	阳光电源	809,452.00	4.03
110	688586	江航装备	805,262.37	4.01
111	688001	华兴源创	804,797.36	4.00
112	300212	易华录	802,296.00	3.99
113	300628	亿联网络	798,574.00	3.97
114	688777	中控技术	797,651.23	3.97
115	300856	科思股份	795,262.00	3.96
116	600547	山东黄金	794,615.00	3.95
117	002409	雅克科技	776,524.00	3.86
118	601231	环旭电子	776,061.00	3.86
119	300363	博腾股份	772,992.00	3.84
120	300253	卫宁健康	769,444.00	3.83
121	300900	广联航空	757,671.00	3.77
122	002475	立讯精密	757,258.31	3.77
123	688700	东威科技	745,420.94	3.71
124	600928	西安银行	742,937.00	3.70
125	000598	兴蓉环境	742,812.00	3.69
126	002517	恺英网络	742,378.00	3.69
127	600900	长江电力	735,229.00	3.66
128	688330	宏力达	734,933.61	3.66
129	002063	远光软件	714,648.00	3.55
130	688116	天奈科技	714,583.76	3.55
131	688578	艾力斯	709,358.40	3.53
132	601138	工业富联	707,832.00	3.52
133	601881	中国银河	707,319.24	3.52
134	601319	中国人保	705,898.00	3.51
135	000002	万 科 A	702,173.00	3.49
136	003031	中瓷电子	701,036.00	3.49
137	002085	万丰奥威	699,378.00	3.48
138	301089	拓新药业	691,950.00	3.44
139	300205	天喻信息	685,941.00	3.41
140	300035	中科电气	685,453.36	3.41

141	300525	博思软件	683,026.00	3.40
142	002317	众生药业	682,594.00	3.39
143	002400	省广集团	679,720.00	3.38
144	300168	万达信息	676,185.00	3.36
145	000048	京基智农	672,275.00	3.34
146	000961	中南建设	670,989.00	3.34
147	300607	拓斯达	669,376.00	3.33
148	002714	牧原股份	669,353.00	3.33
149	000656	金科股份	662,358.00	3.29
150	688521	芯原股份	660,542.93	3.29
151	688639	华恒生物	657,384.00	3.27
152	600895	张江高科	655,720.00	3.26
153	601668	中国建筑	654,167.00	3.25
154	000932	华菱钢铁	652,766.00	3.25
155	002222	福晶科技	650,136.00	3.23
156	600380	健康元	649,402.00	3.23
157	600863	内蒙华电	649,251.00	3.23
158	002034	旺能环境	648,270.00	3.22
159	002088	鲁阳节能	647,788.00	3.22
160	300684	中石科技	643,468.00	3.20
161	688158	优刻得	642,087.42	3.19
162	300655	晶瑞电材	636,984.00	3.17
163	002867	周大生	635,613.75	3.16
164	603105	芯能科技	635,583.24	3.16
165	600667	太极实业	632,133.00	3.14
166	300661	圣邦股份	628,007.00	3.12
167	002832	比音勒芬	627,739.00	3.12
168	688017	绿的谐波	620,170.44	3.08
169	300760	迈瑞医疗	617,703.00	3.07
170	605507	国邦医药	614,061.00	3.05
171	002865	钧达股份	611,831.24	3.04
172	600188	兖矿能源	606,835.00	3.02
173	603108	润达医疗	603,684.00	3.00
174	002020	京新药业	583,193.00	2.90
175	300009	安科生物	582,511.00	2.90
176	002230	科大讯飞	580,764.00	2.89
177	002174	游族网络	575,372.00	2.86
178	300423	昇辉科技	574,316.00	2.86
179	002697	红旗连锁	573,655.00	2.85
180	601009	南京银行	573,350.00	2.85
181	603993	洛阳钼业	572,987.00	2.85
182	601868	中国能建	572,839.00	2.85
183	600089	特变电工	571,937.00	2.84

184	002065	东华软件	570,698.00	2.84
185	600958	东方证券	566,349.00	2.82
186	601106	中国一重	563,900.00	2.80
187	300761	立华股份	562,983.60	2.80
188	002318	久立特材	559,665.00	2.78
189	301031	中熔电气	559,162.00	2.78
190	603000	人民网	551,591.00	2.74
191	000933	神火股份	551,090.00	2.74
192	002847	盐津铺子	543,319.00	2.70
193	603235	天新药业	539,775.00	2.68
194	688208	道通科技	539,708.04	2.68
195	300910	瑞丰新材	539,103.00	2.68
196	688499	利元亨	538,997.70	2.68
197	600742	一汽富维	537,414.00	2.67
198	688037	芯源微	533,953.92	2.66
199	002215	诺普信	533,868.00	2.66
200	002303	美盈森	532,608.00	2.65
201	300567	精测电子	531,502.00	2.64
202	600036	招商银行	530,489.00	2.64
203	300079	数码视讯	527,432.00	2.62
204	688005	容百科技	527,417.77	2.62
205	600030	中信证券	526,833.00	2.62
206	300151	昌红科技	526,712.00	2.62
207	603599	广信股份	526,418.00	2.62
208	000676	智度股份	526,181.00	2.62
209	603328	依顿电子	517,709.00	2.57
210	002049	紫光国微	516,535.00	2.57
211	688256	寒武纪	511,478.00	2.54
212	300015	爱尔眼科	511,245.00	2.54
213	601077	渝农商行	510,230.00	2.54
214	600435	北方导航	505,979.00	2.52
215	002683	广东宏大	505,647.00	2.51
216	002156	通富微电	504,261.00	2.51
217	688009	中国通号	503,863.30	2.51
218	300687	赛意信息	499,508.00	2.48
219	002838	道恩股份	496,980.00	2.47
220	300672	国科微	496,192.00	2.47
221	601857	中国石油	495,677.00	2.47
222	601198	东兴证券	493,814.00	2.46
223	688800	瑞可达	490,492.71	2.44
224	000338	潍柴动力	482,518.00	2.40
225	600775	南京熊猫	476,767.00	2.37
226	601992	金隅集团	475,647.00	2.37

227	002777	久远银海	475,079.00	2.36
228	688083	中望软件	471,806.84	2.35
229	688088	虹软科技	471,789.04	2.35
230	601186	中国铁建	470,061.00	2.34
231	600909	华安证券	468,021.00	2.33
232	002415	海康威视	467,608.00	2.33
233	688711	宏微科技	464,895.79	2.31
234	601899	紫金矿业	462,001.00	2.30
235	002015	协鑫能科	461,715.00	2.30
236	605369	拱东医疗	461,259.00	2.29
237	688277	天智航	456,794.63	2.27
238	300666	江丰电子	452,851.00	2.25
239	300428	立中集团	446,778.00	2.22
240	688680	海优新材	446,718.04	2.22
241	600578	京能电力	445,609.00	2.22
242	300203	聚光科技	443,915.00	2.21
243	002372	伟星新材	440,217.00	2.19
244	688268	华特气体	437,278.05	2.17
245	600971	恒源煤电	436,489.00	2.17
246	300653	正海生物	433,121.00	2.15
247	000682	东方电子	433,036.00	2.15
248	300456	赛微电子	430,735.15	2.14
249	002649	博彦科技	430,573.00	2.14
250	600705	中航产融	429,996.00	2.14
251	300723	一品红	429,359.00	2.14
252	688019	安集科技	429,290.77	2.14
253	002176	江特电机	427,440.00	2.13
254	601799	星宇股份	424,277.00	2.11
255	300395	菲利华	424,149.00	2.11
256	300487	蓝晓科技	423,219.00	2.10
257	300502	新易盛	421,672.00	2.10
258	601212	白银有色	421,616.00	2.10
259	300149	睿智医药	421,231.00	2.10
260	300101	振芯科技	419,999.00	2.09
261	002056	横店东磁	419,674.00	2.09
262	002252	上海莱士	418,660.00	2.08
263	000938	紫光股份	418,291.00	2.08
264	688686	奥普特	418,006.96	2.08
265	002993	奥海科技	416,101.00	2.07
266	002991	甘源食品	415,676.00	2.07
267	300406	九强生物	415,526.00	2.07
268	002129	TCL 中环	412,590.50	2.05
269	600438	通威股份	411,173.00	2.05

270	601179	中国西电	408,706.00	2.03
271	600131	国网信通	406,468.00	2.02
272	300027	华谊兄弟	403,317.00	2.01
273	600039	四川路桥	403,207.00	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	325,296,069.59
卖出股票收入（成交）总额	310,807,606.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将基于国内股指期货市场的现状，根据上期沪深 300 股指期货当月合约的基差率的高低决定股票资产的投资比例。当基差率处于历史较高水平时，股指期货贴水收敛甚至为升水状态，本基金将配置较高比例的股票资产；反之，将适当降低股票资产的比例配置，以降低股指期货贴水对投资收益产生的负面影响。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末,本基金持有股票资产 24,948,151.27 元,占基金资产净值的比例为 75.04%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值 23,609,040.00 元,占基金资产净值的比例为 71.01%,空头合约市值占股票资产的比例为 94.63%。本报告期内,本基金执行市场中性策略的投资收益为 84,510.75 元,公允价值变动损益为-459,727.51 元。

7.13 投资组合报告附注

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

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 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。

7.13.3 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	2,896,248.88
2	应收清算款	63,511.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	80,210.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,039,970.58

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
德邦量化对冲混合 A	357	59,215.06	9,999,200.00	47.30	11,140,576.05	52.70
德邦量化对冲混合 C	5,979	2,603.99	2,222,346.74	14.27	13,346,928.44	85.73
合计	6,336	5,793.73	12,221,546.74	33.29	24,487,504.49	66.71

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	德邦量化对冲混合 A	210,090.99	0.9938
	德邦量化对冲混合 C	35,469.03	0.2278
	合计	245,560.02	0.6689

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	德邦量化对冲混合 A	10~50
	德邦量化对冲混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	德邦量化对冲混合 A	0
	德邦量化对冲混合 C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资	9,999,200.00	27.24	9,999,200.00	27.24	3 年

金					
基金管理人高级管理人员	214,728.10	0.58	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,213,928.10	27.82	9,999,200.00	27.24	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	德邦量化对冲混合 A	德邦量化对冲混合 C
基金合同生效日 (2020年4月29日)基金份额总额	134,483,456.24	57,473,082.79
本报告期期初基金份额总额	17,469,286.43	4,535,818.82
本报告期基金总申购份额	13,604,728.82	224,974,489.77
减：本报告期基金总赎回份额	9,934,239.20	213,941,033.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	21,139,776.05	15,569,275.18

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，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、基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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 (%)	
长江证券	2	636,103,675.90	100.00	210,745.52	100.00	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 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，本基金新增中银国际证券的交易单元；减少华鑫证券、东吴证券的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	44,708.17	100.00	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

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基金参加工商银行个人电子银行费率优惠活动及 2023 倾心回馈基金定投优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 3 日
2	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 9 日
3	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 18 日
4	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 1 月 19 日
5	德邦基金管理有限公司关于旗下部	中国证监会基金电子披	2023 年 2 月 3 日

	分基金增加国金证券为销售机构的公告	露网站及基金管理人网站	
6	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 6 日
7	德邦基金管理有限公司关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金增加财信证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 13 日
8	德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 2 月 18 日
9	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 C 类份额）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	2023 年 3 月 1 日
10	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 A 类份额）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	2023 年 3 月 1 日
11	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 1 日
12	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 C 类份额）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	2023 年 3 月 3 日
13	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 A 类份额）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	2023 年 3 月 3 日
14	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书(2023 年第 1 号)	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 3 日
15	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 8 日
16	德邦基金管理有限公司关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金增加兴业证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 22 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	2023 年 3 月 24 日

18	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 30 日
19	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 31 日
20	德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 1 日
21	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信百信银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 4 日
22	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 10 日
23	德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 14 日
24	德邦基金管理有限公司关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金增加华泰证券为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 14 日
25	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年度新增港股通交易日照常开放申购（含转换转入及定期定额投资）、赎回（含转换转出）业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 24 日
26	德邦基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在平安证券最低申购（含定期定额投资）金额、追加申购最低金额的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 4 月 26 日
27	德邦基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 5 月 17 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

机构	1	20230101 - 20230328 , 20230523 - 20230630	9,999,200 .00	0.00	0.00	9,999,200.00	27.24 00
	2	20230329 - 20230329	0.00	22,331, 397.95	22,331,39 7.95	0.00	0.000 0
	3	20230321 - 20230328	0.00	11,154, 989.85	11,154,98 9.85	0.00	0.000 0
个人	1	20230517 - 20230521	0.00	27,765, 437.58	27,765,43 7.58	0.00	0.000 0

产品特有风险

- 1、本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的大额赎回，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、单一投资者赎回后，若本基金连续 50 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、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、报告期内按照规定披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-821-7788

德邦基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日