

德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 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：国泰君安证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰君安证券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	6
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	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
§ 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	55

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	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
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	71
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	71
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	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§ 9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
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	74
§ 10 开放式基金份额变动	74
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
11.8 其他重大事件	77
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 13 备查文件目录	82
13.1 备查文件目录	82
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）	
基金简称	量化优选	
基金主代码	167702	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2017 年 3 月 24 日	
基金管理人	德邦基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	71,152,369.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
下属分级基金的场内简称	量化优选	优选 C
下属分级基金的交易代码	167702	167703
报告期末下属分级基金的份额总额	25,563,278.62 份	45,589,090.69 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		德邦基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张秀玉	帅芳
	联系电话	021-26010852	021-38031815
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	shuaifang@gtjas.com
客户服务电话		4008217788	021-38917599-5
传真		021-26010808	021-38677819
注册地址		上海市虹口区东大名路 501 号	中国（上海）自由贸易试验区

	503B 单元	商城路 618 号
办公地址	上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元	上海市静安区新闸路 669 号博 华广场 19 楼
邮政编码	200010	200041
法定代表人	左畅	贺青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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	中国证券登记结算有限责任 公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、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	
	德邦量化优选 股票 A	德邦量化优选 股票 C	德邦量化优选 股票 A	德邦量化优选 股票 C	德邦量化优选 股票 A	德邦量化优选 股票 C
本期 已实 现收 益	-1,918,936.02	-5,452,020.64	754,808.11	1,887,333.20	10,754,726.92	21,826,075.26
本期 利润	-2,770,271.48	-6,563,878.85	-598,092.97	-1,199,524.00	9,013,659.53	18,667,271.13
加权 平均 基金 份额 本期 利润	-0.2407	-0.2352	-0.0926	-0.0542	0.4811	0.4221
本期 加权 平均 净值 利润 率	-18.61%	-18.66%	-5.75%	-3.45%	32.13%	27.22%

本期基金份额净值增长率	-15.53%	-15.74%	-8.61%	-8.84%	35.36%	35.01%
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	6,609,568.35	10,390,707.08	3,416,944.17	10,706,210.14	10,175,197.81	29,281,046.60
期末可供分配基金份额利润	0.2586	0.2279	0.4900	0.4573	0.6304	0.5987
期末基金资产净值	32,172,846.97	55,979,797.77	10,390,929.62	34,116,272.71	26,316,734.65	78,185,054.73
期末基金份额净值	1.2586	1.2279	1.4900	1.4573	1.6304	1.5987
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	43.52%	40.35%	69.91%	66.57%	85.92%	82.73%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦量化优选股票 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	2.73%	1.12%	1.69%	1.23%	1.04%	-0.11%
过去六个月	-6.98%	1.12%	-13.00%	1.05%	6.02%	0.07%
过去一年	-15.53%	1.34%	-20.58%	1.22%	5.05%	0.12%
过去三年	4.49%	1.33%	-4.89%	1.24%	9.38%	0.09%
过去五年	22.16%	1.29%	-3.20%	1.23%	25.36%	0.06%
自基金合同生效 起至今	43.52%	1.23%	11.89%	1.17%	31.63%	0.06%

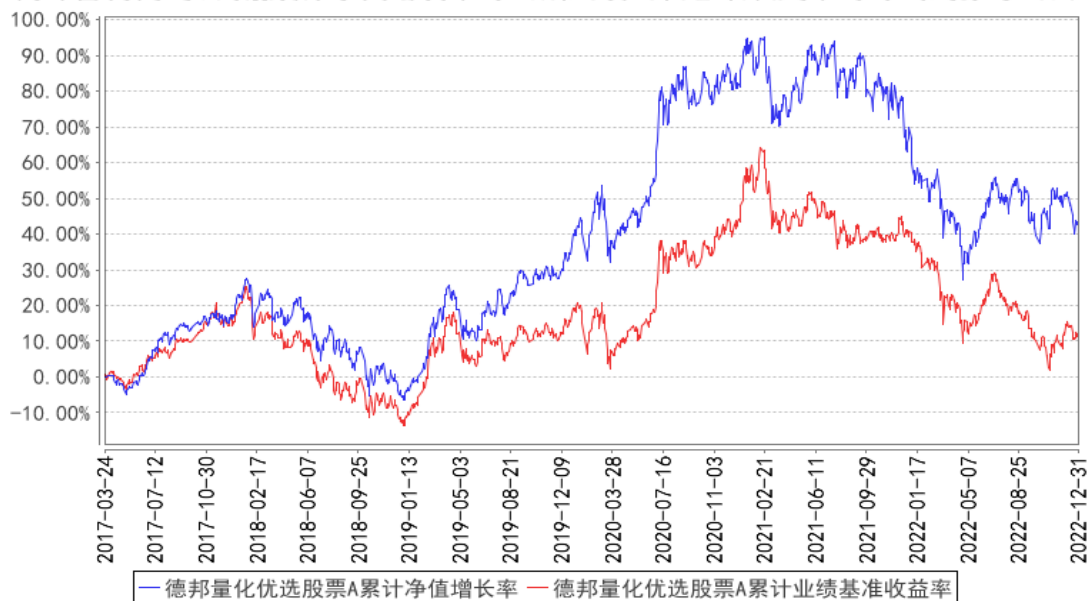
德邦量化优选股票 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	2.66%	1.12%	1.69%	1.23%	0.97%	-0.11%
过去六个月	-7.10%	1.12%	-13.00%	1.05%	5.90%	0.07%
过去一年	-15.74%	1.34%	-20.58%	1.22%	4.84%	0.12%
过去三年	3.69%	1.33%	-4.89%	1.24%	8.58%	0.09%
过去五年	20.24%	1.29%	-3.20%	1.23%	23.44%	0.06%
自基金合同生效 起至今	40.35%	1.23%	11.89%	1.17%	28.46%	0.06%

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

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

德邦量化优选股票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

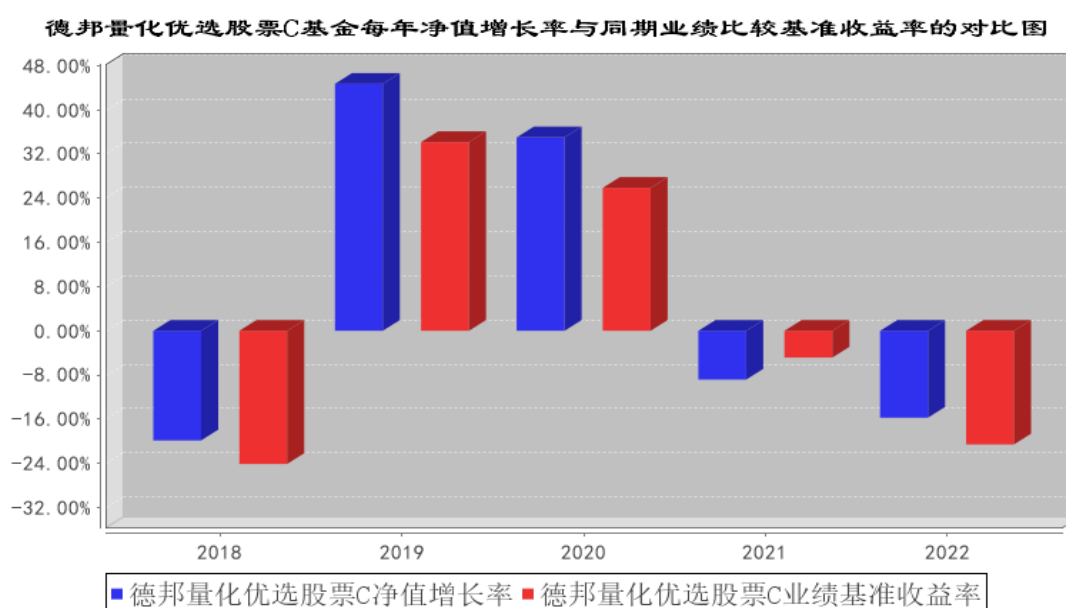
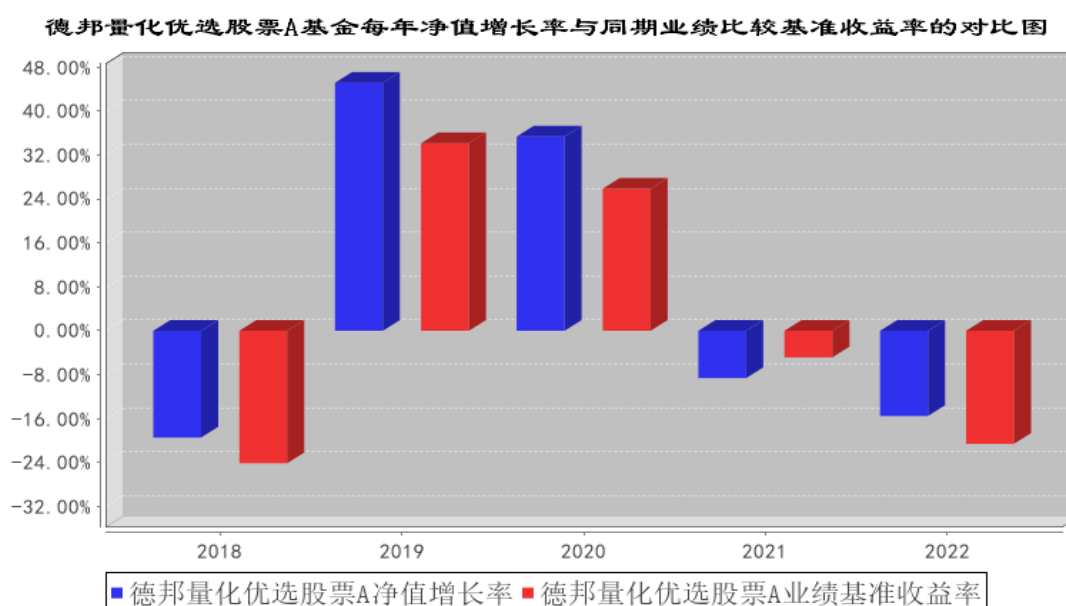


德邦量化优选股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2017 年 03 月 24 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满 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 2017 年 03 月 24 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 2017 年 3 月 24 日，2017 年度数据根据合同生效当年实际存续期（2017 年 3 月 24 日至 2017 年 12 月 31 日）计算，不按照整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

德邦量化优选股票 A

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	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	2.1000	2,359,918.7	85,101.43	2,445,020.1	-

		2		5	
合计	2.1000	2,359,918.72	85,101.43	2,445,020.15	-

德邦量化优选股票 C

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	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	2.1000	10,273,496.85	32,558.44	10,306,055.29	-
合计	2.1000	10,273,496.85	32,558.44	10,306,055.29	-

§ 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		
吴 志 鹏	本基金的基金经理	2021 年 6 月 29 日	—	6 年	硕士，于 2016 年 4 月加入德邦基金管理有限公司，历任投资三部（量化）研究员，专户投资部投资经理，量化投资部研究员。现任德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦民裕进取量化精选灵活配置混合型证券投资基金、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、德邦上证 G60 创新综合指数增强型发起式证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦惠利混合型证券投资基金的基金经理。
李 荣 兴	本基金的基金经理	2022 年 6 月 17 日	—	11 年	硕士，北京大学计算机系硕士，2011 年起历任国信证券金融工程分析师，光大富尊投资有限公司量化投资经理，太平资产量化投资部投资经理。2022 年 3 月加入德邦基金，现任德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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。

4.3.2.1 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

回顾 2022 年全年，上半年市场在俄乌冲突，上海疫情，市场自身去杠杆等一系列内忧外患事件的共同作用下，上证指数一度跌破 3000 点的整数心理大关。但好在流动性非常充裕，市场在跌到某个平衡点之后就开启了报复性反弹。小市值的板块在杠杆出清之后，表现出极强的韧性，引领市场反弹。下半年，在内有外因的共同作用下，风险偏好再次恶化，指数再次出现大幅回调，部分行业甚至跌破同年 4 月的低点。进入 4 季度，各项积极的政策陆续出台，疫情这个影响了三年的因素在逐步弱化，经济复苏的预期不断升温，各项积极的政策也有望在 2023 年陆续出台，A 股即将迎来基本面与估值修复的一年。

从估值的角度来看，当前沪深 300 指数市盈率 11 倍左右，低于历史均值，极具性价比。

在投资管理上，本基金坚持采取量化策略进行投资管理与风险控制，通过结合海量因子驱动的人工智能模型、以基本面为驱动的多因子选股模型，把握优质个股的投资机会，积极获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末德邦量化优选股票 A 基金份额净值为 1.2586 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.53%；截至本报告期末德邦量化优选股票 C 基金份额净值为 1.2279 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.74%；同期业绩比较基准收益率为-20.58%。

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 2023 年，市场方面，从市场自身的周期来看，目前处于市场周期的底部区域，当前的周期特征与 05 年下半年的特征非常类似。在周期底部的时候，悲观的声音成为主流，在内忧外患中看不到希望，但如果我们回顾历史，最绝望的时候往往也是希望开始的时候，05 年上证在跌破 998 点之后一路向上冲到了 6124 点。所以我们整体对权益市场中长期的维度还是非常乐观的。板块方面相对看好制造业以及 TMT。制造业方面，以重卡，叉车这类制造业早周期的数据中已经可以看到经济复苏的影子，机床，刀具这些制造业同步指标也在逐渐改善，所以，对于 2023 年制造业的复苏，我也是非常乐观的。TMT 方面，偏消费端的半导体周期也即将见底，同时股价也调整了非常多，估值也处于较低水平，今年有望迎来估值与盈利的双升。传媒方面，作为游戏行业“晴雨表”的游戏版号在收紧多年后又开始重新发放，有重要的指示意义，相关公司同样有望迎来估值与盈利的双升。

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历。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

本报告期内本基金未进行利润分配。

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

本基金本报告期内，基金资产出现连续二十个工作日以上净值低于五千万元的情形，至本报告期末，净值已恢复至五千万元以上。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 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_B14 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	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）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，后附的德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）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，公允反映了德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）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，我们独立于德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF），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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）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。 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。 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。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。

管理层和治理层对财务报表的责任	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。 在编制财务报表时,管理层负责评估德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)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。 治理层负责监督德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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: (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。 (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。 (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。 (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,就可能导致对德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)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量化优选股票型证券投资基金(LOF)不能持续经营。 (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。 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。

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：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

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	8,264,591.53	3,116,826.38
结算备付金		582,384.19	422,189.01
存出保证金		98,476.93	67,938.53
交易性金融资产	7.4.7.2	78,036,402.08	41,553,982.08
其中：股票投资		78,036,402.08	41,553,982.08
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		1,859,517.57	85,276.78
应收股利		-	-
应收申购款		16,101.60	3,778.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	1,977.00
资产总计		88,857,473.90	45,251,968.00
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		-	391,038.72
应付赎回款		231,925.07	498.73
应付管理人报酬		66,898.06	41,237.13
应付托管费		13,379.59	8,247.43
应付销售服务费		10,575.90	8,063.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	382,050.54	295,679.89
负债合计		704,829.16	744,765.67
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	71,152,369.31	30,384,048.02
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	17,000,275.43	14,123,154.31
净资产合计		88,152,644.74	44,507,202.33
负债和净资产总计		88,857,473.90	45,251,968.00

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，德邦量化优选股票 A 基金份额净值 1.2586 元，基金份额总额 25,563,278.62 份；德邦量化优选股票 C 基金份额净值 1.2279 元，基金份额总额 45,589,090.69 份。量化优选份额总额合计 71,152,369.31 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：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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		-8,525,764.39	299,572.24
1. 利息收入		97,046.32	69,981.82

其中：存款利息收入	7.4.7.13	97,046.32	69,978.93
债券利息收入		-	2.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,779,121.17	4,624,353.93
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-7,152,938.18	4,166,934.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	962.03	9,071.71
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-414,864.10	-
股利收益	7.4.7.19	787,719.08	448,347.52
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	-1,963,193.67	-4,439,758.28
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	119,504.13	44,994.77
减：二、营业总支出		808,385.94	2,097,189.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	497,275.34	454,965.35
2. 托管费	7.4.10.2.2	99,455.02	90,993.05
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	87,655.58	87,710.63
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	124,000.00	1,463,520.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,334,150.33	-1,797,616.97
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,334,150.33	-1,797,616.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-9,334,150.33	-1,797,616.97

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：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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）	30,384,048.02	-	14,123,154.31	44,507,202.33
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	30,384,048.02	-	14,123,154.31	44,507,202.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	40,768,321.29	-	2,877,121.12	43,645,442.41
（一）、综合收益总额	-	-	-9,334,150.33	-9,334,150.33
（二）、本期基金份额交易产	40,768,321.29	-	12,211,271.45	52,979,592.74

生的基金 净值变动 数 (净值减 少以“-” 号填列)				
其中：1. 基金申购 款	84,114,283.23	-	23,988,345.47	108,102,628.70
2. 基金赎回 款	-43,345,961.94	-	-11,777,074.02	-55,123,035.96
(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)	71,152,369.31	-	17,000,275.43	88,152,644.74
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
一、上期 期末净资 产(基金 净值)	65,045,544.97	-	39,456,244.41	104,501,789.38
加：会计 政策变更	-	-	-	-
前期 差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期 期初净资	65,045,544.97	-	39,456,244.41	104,501,789.38

产（基金净值）				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-34,661,496.95	-	-25,333,090.10	-59,994,587.05
（一）、综合收益总额	-	-	-1,797,616.97	-1,797,616.97
（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）	-34,661,496.95	-	-23,535,473.13	-58,196,970.08
其中：1. 基金申购款	36,865,270.44	-	20,977,582.96	57,842,853.40
2. 基金赎回款	-71,526,767.39	-	-44,513,056.09	-116,039,823.48
（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）	30,384,048.02	-	14,123,154.31	44,507,202.33

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：

<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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]1708 号文《关于准予德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）注册的批复》准予注册，由基金管理人德邦基金管理有限公司向社会公开募集。基金合同于 2017 年 3 月 24 日生效。首次设立时募集规模为 201,030,406.44 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为德邦基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含存托凭证）、债券（含中小企业私募债券）、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

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) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值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。登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2) 基金份额持有人可对 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费。同一投资人在同一销售机构持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式；

(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) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各基金份额类别分别制定收益分配方案，本基金同一基金份额类别内的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 3,116,826.38 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,734.34 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,118,560.72 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 422,189.01 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 209.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 422,398.01 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 67,938.53 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 33.66 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 67,972.19 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,977.00 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 1,734.34 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 209.00 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 33.66 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

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

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

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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发展费附加的单位外）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	8,264,591.53	3,116,826.38
等于：本金	8,260,636.55	3,116,826.38
加：应计利息	3,954.98	-
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	8,264,591.53	3,116,826.38

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	81,051,449.44	-	78,036,402.08	-3,015,047.36
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	81,051,449.44	-	78,036,402.08	-3,015,047.36
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	42,605,835.77	-	41,553,982.08	-1,051,853.69
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		42,605,835.77	-	41,553,982.08	-1,051,853.69

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	-	1,977.00
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	1,977.00

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	107.30	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	136,943.24	126,679.89
其中：交易所市场	136,943.24	126,679.89
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付信息披露费	200,000.00	120,000.00
应付审计费	45,000.00	40,000.00
应付账户维护费	-	9,000.00
合计	382,050.54	295,679.89

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

德邦量化优选股票 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
----	--

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,973,985.45	6,973,985.45
本期申购	24,063,463.56	24,063,463.56
本期赎回（以“-”号填列）	-5,474,170.39	-5,474,170.39
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	25,563,278.62	25,563,278.62

德邦量化优选股票 C

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	23,410,062.57	23,410,062.57
本期申购	60,050,819.67	60,050,819.67
本期赎回（以“-”号填列）	-37,871,791.55	-37,871,791.55
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	45,589,090.69	45,589,090.69

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

德邦量化优选股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,267,999.72	-1,851,055.55	3,416,944.17
本期利润	-1,918,936.02	-851,335.46	-2,770,271.48
本期基金份额交易产生的变动数	11,380,326.47	-5,417,430.81	5,962,895.66
其中：基金申购款	14,487,745.52	-6,953,750.13	7,533,995.39
基金赎回款	-3,107,419.05	1,536,319.32	-1,571,099.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,729,390.17	-8,119,821.82	6,609,568.35

德邦量化优选股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	16,792,659.17	-6,086,449.03	10,706,210.14
本期利润	-5,452,020.64	-1,111,858.21	-6,563,878.85
本期基金份额交易产生	13,228,368.61	-6,979,992.82	6,248,375.79

的变动数			
其中：基金申购款	34,088,888.16	-17,634,538.08	16,454,350.08
基金赎回款	-20,860,519.55	10,654,545.26	-10,205,974.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,569,007.14	-14,178,300.06	10,390,707.08

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	85,608.49	63,058.73
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	9,949.72	5,044.58
其他	1,488.11	1,875.62
合计	97,046.32	69,978.93

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	-7,152,938.18	4,166,934.70
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	-7,152,938.18	4,166,934.70

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	659,594,169.76	450,731,657.23
减：卖出股票成本总额	665,130,136.02	446,564,722.53

减：交易费用	1,616,971.92	-
买卖股票差价收入	-7,152,938.18	4,166,934.70

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	1,112.33	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-150.30	9,071.71
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	962.03	9,071.71

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	306,000.00	40,474.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	300,150.00	31,400.00
减：应计利息总额	6,000.00	2.89
减：交易费用	0.30	-
买卖债券差价收入	-150.30	9,071.71

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股指期货-投资收益	-414,864.10	-
股指期货投资收益	-414,864.10	-

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	787,719.08	448,347.52
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	787,719.08	448,347.52

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	-1,963,193.67	-4,439,758.28
股票投资	-1,963,193.67	-4,439,758.28
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-1,963,193.67	-4,439,758.28

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	119,504.13	44,994.77
合计	119,504.13	44,994.77

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	35,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

账户维护费	9,000.00	-
交易费用	-	1,276,520.18
债券账户维护费	-	27,000.00
合计	124,000.00	1,463,520.18

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、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”）	基金托管人
德邦证券股份有限公司（“德邦证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
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	-	-	-	-
国泰君安证券	290,484,907.47	21.31	84,662,119.66	9.99

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（%）
国泰君安证券	270,529.48	31.97	-	-
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（%）
国泰君安证券	78,846.00	10.52	17,885.70	14.12

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	497,275.34	454,965.35
其中：支付销售机构的客户维护费	107,185.30	51,132.36

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

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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	99,455.02	90,993.05
----------------	-----------	-----------

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

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C	合计
德邦基金	—	59,818.56	59,818.56
德邦证券	—	171.24	171.24
国泰君安	—	10.95	10.95
合计	—	60,000.75	60,000.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C	合计
国泰君安	—	18.06	18.06
德邦基金	—	80,615.20	80,615.20
德邦证券	—	169.18	169.18
合计	—	80,802.44	80,802.44

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

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	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	0.00	—
报告期间申购/买入总份额	3,045,263.09	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
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	3,045,263.09	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.9126%	—
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	—	—

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-
-------------------------	---	---

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

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

德邦量化优选股票 C

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	16,221,243.47	35.5814	16,221,243.47	69.2900

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
国泰君安证券	8,264,591.53	85,608.49	3,116,826.38	63,058.73

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安证券股份有限公司保管，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

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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。

7.4.12.2 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。

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，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。（2021 年 12 月 31 日：同）

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，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	8,264,591.53	-	-	-	-	-	8,264,591.53
结算备付金	582,384.19	-	-	-	-	-	582,384.19
存出保证金	98,476.93	-	-	-	-	-	98,476.93
交易性金融资产	-	-	-	-	-	78,036,402.08	78,036,402.08
应收申购款	-	-	-	-	-	16,101.60	16,101.60
应收清算款	-	-	-	-	-	1,859,517.57	1,859,517.57
资产总计	8,945,452.65	-	-	-	-	79,912,021.25	88,857,473.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	231,925.07	231,925.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	66,898.06	66,898.06
应付托管费	-	-	-	-	-	13,379.59	13,379.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,575.90	10,575.90
其他负债	-	-	-	-	-	382,050.54	382,050.54
负债总计	-	-	-	-	-	704,829.16	704,829.16

利率敏感度缺口	8,945,452.65	-	-	-	-	-79,207,192.09	88,152,644.74
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,116,826.38	-	-	-	-	-	3,116,826.38
结算备付金	422,189.01	-	-	-	-	-	422,189.01
存出保证金	67,938.53	-	-	-	-	-	67,938.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-41,553,982.08	41,553,982.08
应收证券清算款	-	-	-	-	-	85,276.78	85,276.78
应收申购款	-	-	-	-	-	3,778.22	3,778.22
其他资产	-	-	-	-	-	1,977.00	1,977.00
资产总计	3,606,953.92	-	-	-	-	-41,645,014.08	45,251,968.00
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	391,038.72	391,038.72
应付赎回款	-	-	-	-	-	498.73	498.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,237.13	41,237.13
应付托管费	-	-	-	-	-	8,247.43	8,247.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	8,063.77	8,063.77
其他负债	-	-	-	-	-	295,679.89	295,679.89
负债总计	-	-	-	-	-	744,765.67	744,765.67
利率敏感度缺口	3,606,953.92	-	-	-	-	-40,900,248.41	44,507,202.33

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

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：同），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	78,036,402.08	88.52	41,553,982.08	93.36
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	78,036,402.08	88.52	41,553,982.08	93.36

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

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%	756,525.52	382,856.41
	沪深 300 下降 1%	-756,525.52	-382,856.41

注：本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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	78,036,402.08	41,553,982.08
第二层次	—	—
第三层次	—	—
合计	78,036,402.08	41,553,982.08

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	股票投资	
期初余额	—	—	—
当期购买	—	—	—
当期出售/结算	—	—	—

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-
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	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

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若。

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	78,036,402.08	87.82
	其中：股票	78,036,402.08	87.82
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	8,846,975.72	9.96
8	其他各项资产	1,974,096.10	2.22
9	合计	88,857,473.90	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	2,768,306.00	3.14
C	制造业	53,302,300.08	60.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,325,790.00	2.64
E	建筑业	1,422,582.00	1.61

F	批发和零售业	1,664,634.00	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	2,654,735.00	3.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,296,250.00	3.74
J	金融业	8,166,543.00	9.26
K	房地产业	1,441,321.00	1.64
L	租赁和商务服务业	888,641.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	105,300.00	0.12
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	78,036,402.08	88.52

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	002368	太极股份	36,600	1,029,558.00	1.17
2	600521	华海药业	47,000	1,027,420.00	1.17
3	601162	天风证券	357,400	1,025,738.00	1.16
4	600026	中远海能	84,000	1,012,200.00	1.15
5	000415	渤海租赁	402,100	888,641.00	1.01
6	600280	中央商场	264,200	863,934.00	0.98
7	600519	贵州茅台	500	863,500.00	0.98
8	002737	葵花药业	36,700	850,706.00	0.97
9	600795	国电电力	195,400	834,358.00	0.95
10	600780	通宝能源	129,600	832,032.00	0.94
11	002869	金溢科技	38,500	828,520.00	0.94
12	300763	锦浪科技	4,600	828,230.00	0.94
13	002832	比音勒芬	32,300	827,203.00	0.94
14	600186	莲花健康	304,900	826,279.00	0.94
15	300750	宁德时代	2,100	826,182.00	0.94
16	000913	钱江摩托	44,700	826,056.00	0.94
17	002929	润建股份	21,000	824,460.00	0.94
18	688239	航宇科技	10,600	823,514.00	0.93
19	600018	上港集团	154,100	822,894.00	0.93

20	688639	华恒生物	5,300	822,825.00	0.93
21	002594	比亚迪	3,200	822,304.00	0.93
22	601186	中国铁建	106,200	820,926.00	0.93
23	688295	中复神鹰	19,000	820,230.00	0.93
24	600575	淮河能源	340,100	819,641.00	0.93
25	603737	三棵树	7,200	819,576.00	0.93
26	603800	道森股份	30,700	819,076.00	0.93
27	605020	永和股份	20,800	817,024.00	0.93
28	300059	东方财富	42,100	816,740.00	0.93
29	600030	中信证券	41,000	816,310.00	0.93
30	603306	华懋科技	21,800	815,538.00	0.93
31	601688	华泰证券	64,000	815,360.00	0.92
32	603398	沐邦高科	28,900	813,824.00	0.92
33	000002	万科 A	44,700	813,540.00	0.92
34	605377	华旺科技	33,100	812,274.00	0.92
35	300203	聚光科技	23,900	810,210.00	0.92
36	688123	聚辰股份	8,000	809,600.00	0.92
37	002841	视源股份	13,700	808,848.00	0.92
38	002179	中航光电	14,000	808,640.00	0.92
39	300687	赛意信息	27,400	808,300.00	0.92
40	000333	美的集团	15,600	808,080.00	0.92
41	300337	银邦股份	104,100	807,816.00	0.92
42	600256	广汇能源	89,500	807,290.00	0.92
43	600438	通威股份	20,900	806,322.00	0.91
44	002634	棒杰股份	82,000	806,060.00	0.91
45	600353	旭光电子	56,000	805,280.00	0.91
46	688006	杭可科技	18,362	803,704.74	0.91
47	002733	雄韬股份	46,800	802,620.00	0.91
48	600188	兖矿能源	23,900	802,562.00	0.91
49	002847	盐津铺子	7,400	801,346.00	0.91
50	605266	健之佳	10,000	800,700.00	0.91
51	002738	中矿资源	12,000	799,920.00	0.91
52	000733	振华科技	7,000	799,610.00	0.91
53	603283	赛腾股份	26,600	798,798.00	0.91
54	603876	鼎胜新材	19,400	796,176.00	0.90
55	688008	澜起科技	12,700	795,020.00	0.90
56	688298	东方生物	10,300	794,233.00	0.90
57	300896	爱美客	1,400	792,890.00	0.90
58	688630	芯碁微装	9,500	792,680.00	0.90
59	688068	热景生物	13,000	791,700.00	0.90
60	300765	新诺威	50,100	790,578.00	0.90
61	002466	天齐锂业	10,000	789,900.00	0.90
62	300174	元力股份	39,500	788,420.00	0.89

63	688707	振华新材	17,500	786,625.00	0.89
64	601318	中国平安	16,300	766,100.00	0.87
65	600999	招商证券	56,900	756,770.00	0.86
66	002371	北方华创	3,300	743,490.00	0.84
67	688221	前沿生物	42,500	733,550.00	0.83
68	000596	古井贡酒	2,700	720,630.00	0.82
69	002446	盛路通信	75,000	717,000.00	0.81
70	688200	华峰测控	2,500	691,175.00	0.78
71	601231	环旭电子	41,800	678,414.00	0.77
72	600900	长江电力	31,400	659,400.00	0.75
73	002198	嘉应制药	99,400	648,088.00	0.74
74	300718	长盛轴承	28,200	643,806.00	0.73
75	601988	中国银行	199,800	631,368.00	0.72
76	002146	荣盛发展	289,300	627,781.00	0.71
77	601088	中国神华	22,500	621,450.00	0.70
78	002422	科伦药业	23,300	620,013.00	0.70
79	601618	中国中冶	189,200	601,656.00	0.68
80	603983	丸美股份	17,100	576,954.00	0.65
81	000617	中油资本	100,200	558,114.00	0.63
82	600522	中天科技	33,400	539,410.00	0.61
83	002979	雷赛智能	23,800	538,118.00	0.61
84	688377	迪威尔	12,200	536,556.00	0.61
85	605117	德业股份	1,600	529,920.00	0.60
86	688103	国力股份	7,900	508,286.00	0.58
87	601229	上海银行	85,500	505,305.00	0.57
88	600019	宝钢股份	89,000	497,510.00	0.56
89	000700	模塑科技	98,200	455,648.00	0.52
90	688313	仕佳光子	45,700	413,585.00	0.47
91	600028	中国石化	94,300	411,148.00	0.47
92	601099	太平洋	157,900	405,803.00	0.46
93	603086	先达股份	30,400	397,936.00	0.45
94	688278	特宝生物	10,000	389,300.00	0.44
95	300645	正元智慧	15,400	387,772.00	0.44
96	688768	容知日新	3,400	384,064.00	0.44
97	601169	北京银行	83,900	361,609.00	0.41
98	605077	华康股份	11,900	361,046.00	0.41
99	601869	长飞光纤	10,900	355,667.00	0.40
100	002821	凯莱英	2,400	355,200.00	0.40
101	603185	上机数控	3,200	338,720.00	0.38
102	603379	三美股份	11,700	332,982.00	0.38
103	002180	纳思达	6,000	311,340.00	0.35
104	300856	科思股份	5,800	302,470.00	0.34
105	002785	万里石	9,800	295,764.00	0.34

106	601012	隆基绿能	6,800	287,368.00	0.33
107	688138	清溢光电	15,400	280,280.00	0.32
108	600389	江山股份	6,200	273,296.00	0.31
109	300532	今天国际	17,000	246,160.00	0.28
110	603360	百傲化学	14,000	245,980.00	0.28
111	688575	亚辉龙	12,300	241,695.00	0.27
112	603290	斯达半导	700	230,510.00	0.26
113	002311	海大集团	3,700	228,401.00	0.26
114	002728	特一药业	9,600	216,480.00	0.25
115	688383	新益昌	2,200	208,736.00	0.24
116	601398	工商银行	42,200	183,148.00	0.21
117	600908	无锡银行	32,800	172,856.00	0.20
118	000166	申万宏源	40,300	160,394.00	0.18
119	603868	飞科电器	2,200	148,126.00	0.17
120	000975	银泰黄金	11,400	125,856.00	0.14
121	601901	方正证券	16,900	107,822.00	0.12
122	002088	鲁阳节能	4,600	106,352.00	0.12
123	603259	药明康德	1,300	105,300.00	0.12
124	002020	京新药业	8,400	102,312.00	0.12
125	002518	科士达	1,500	86,400.00	0.10
126	600919	江苏银行	11,400	83,106.00	0.09
127	300820	英杰电气	1,100	80,828.00	0.09
128	688198	佰仁医疗	140	18,060.00	0.02
129	688499	利元亨	109	17,154.42	0.02
130	688305	科德数控	174	15,399.00	0.02
131	688733	壹石通	172	6,479.24	0.01
132	688690	纳微科技	110	5,694.70	0.01
133	688319	欧林生物	54	748.98	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	300750	宁德时代	5,794,468.00	13.02
2	300274	阳光电源	5,475,829.64	12.30
3	600519	贵州茅台	4,441,273.00	9.98
4	601318	中国平安	4,433,754.00	9.96
5	000333	美的集团	4,352,420.02	9.78
6	002466	天齐锂业	4,335,952.00	9.74
7	002241	歌尔股份	4,194,226.00	9.42
8	601186	中国铁建	3,999,047.00	8.99
9	600036	招商银行	3,888,555.00	8.74
10	600585	海螺水泥	3,852,172.00	8.66

11	000858	五粮液	3,752,879.00	8.43
12	002821	凯莱英	3,565,496.00	8.01
13	688111	金山办公	3,422,814.83	7.69
14	600900	长江电力	3,390,971.00	7.62
15	600438	通威股份	3,093,122.00	6.95
16	601985	中国核电	3,091,830.00	6.95
17	300122	智飞生物	3,065,733.00	6.89
18	002594	比亚迪	3,021,432.00	6.79
19	002865	钧达股份	3,014,100.00	6.77
20	300769	德方纳米	2,985,693.00	6.71
21	601618	中国中冶	2,957,013.00	6.64
22	688599	天合光能	2,942,092.16	6.61
23	600309	万华化学	2,895,191.00	6.50
24	000100	TCL 科技	2,877,458.00	6.47
25	601988	中国银行	2,866,976.18	6.44
26	002475	立讯精密	2,859,511.00	6.42
27	300059	东方财富	2,802,515.80	6.30
28	300595	欧普康视	2,769,042.00	6.22
29	600018	上港集团	2,754,643.00	6.19
30	300142	沃森生物	2,726,617.00	6.13
31	000725	京东方 A	2,706,299.00	6.08
32	002371	北方华创	2,700,715.00	6.07
33	000596	古井贡酒	2,687,420.00	6.04
34	601162	天风证券	2,666,917.00	5.99
35	603260	合盛硅业	2,645,947.00	5.94
36	001289	龙源电力	2,644,120.76	5.94
37	601169	北京银行	2,542,084.00	5.71
38	601975	招商南油	2,528,132.00	5.68
39	000625	长安汽车	2,515,280.00	5.65
40	603398	沐邦高科	2,513,176.00	5.65
41	603613	国联股份	2,504,799.00	5.63
42	688032	禾迈股份	2,472,686.00	5.56
43	600089	特变电工	2,460,414.00	5.53
44	600111	北方稀土	2,452,092.00	5.51
45	002329	皇氏集团	2,436,514.00	5.47
46	601012	隆基绿能	2,405,310.00	5.40
47	603501	韦尔股份	2,395,976.00	5.38
48	002179	中航光电	2,376,273.40	5.34
49	002709	天赐材料	2,374,023.00	5.33
50	002738	中矿资源	2,359,765.00	5.30
51	688561	奇安信	2,313,192.26	5.20
52	000977	浪潮信息	2,268,112.00	5.10
53	300601	康泰生物	2,248,877.00	5.05

54	300465	高伟达	2,192,031.00	4.93
55	688036	传音控股	2,188,600.28	4.92
56	000792	盐湖股份	2,176,608.00	4.89
57	603283	赛腾股份	2,158,899.00	4.85
58	601398	工商银行	2,148,916.00	4.83
59	002841	视源股份	2,133,034.76	4.79
60	601600	中国铝业	2,117,132.59	4.76
61	603259	药明康德	2,116,290.00	4.75
62	601800	中国交建	2,096,722.00	4.71
63	688408	中信博	2,095,468.20	4.71
64	002634	棒杰股份	2,056,453.00	4.62
65	601288	农业银行	2,045,445.00	4.60
66	600999	招商证券	2,003,736.00	4.50
67	600028	中国石化	1,997,750.00	4.49
68	300518	盛讯达	1,992,734.00	4.48
69	000002	万科 A	1,970,256.00	4.43
70	002731	萃华珠宝	1,948,194.00	4.38
71	688123	聚辰股份	1,935,735.80	4.35
72	600026	中远海能	1,922,968.00	4.32
73	300782	卓胜微	1,917,345.00	4.31
74	300760	迈瑞医疗	1,916,787.00	4.31
75	002192	融捷股份	1,885,144.00	4.24
76	300498	温氏股份	1,885,046.60	4.24
77	688063	派能科技	1,884,266.77	4.23
78	300337	银邦股份	1,879,925.00	4.22
79	002129	TCL 中环	1,864,902.00	4.19
80	000768	中航西飞	1,855,699.00	4.17
81	002756	永兴材料	1,841,977.00	4.14
82	688390	固德威	1,837,362.18	4.13
83	002585	双星新材	1,830,727.00	4.11
84	600536	中国软件	1,808,930.00	4.06
85	601336	新华保险	1,798,048.00	4.04
86	688091	上海谊众	1,793,977.91	4.03
87	603799	华友钴业	1,786,999.00	4.02
88	300705	九典制药	1,778,961.00	4.00
89	600436	片仔癀	1,768,508.00	3.97
90	000338	潍柴动力	1,763,574.00	3.96
91	603993	洛阳钼业	1,754,460.00	3.94
92	603392	万泰生物	1,742,366.75	3.91
93	600256	广汇能源	1,707,070.00	3.84
94	601633	长城汽车	1,699,484.00	3.82
95	002460	赣锋锂业	1,692,105.00	3.80
96	600030	中信证券	1,677,564.00	3.77

97	601857	中国石油	1,672,017.00	3.76
98	603595	东尼电子	1,669,129.00	3.75
99	002791	坚朗五金	1,659,349.00	3.73
100	600745	闻泰科技	1,659,159.00	3.73
101	300896	爱美客	1,639,306.15	3.68
102	300763	锦浪科技	1,611,653.00	3.62
103	300035	中科电气	1,611,461.00	3.62
104	600575	淮河能源	1,604,808.00	3.61
105	300014	亿纬锂能	1,568,792.00	3.52
106	002352	顺丰控股	1,556,501.00	3.50
107	002837	英维克	1,554,903.00	3.49
108	603605	珀莱雅	1,551,832.00	3.49
109	600763	通策医疗	1,537,763.00	3.46
110	000656	金科股份	1,525,823.00	3.43
111	002943	宇晶股份	1,525,256.00	3.43
112	688630	芯碁微装	1,525,153.08	3.43
113	601668	中国建筑	1,524,899.00	3.43
114	001979	招商蛇口	1,524,814.00	3.43
115	300910	瑞丰新材	1,524,495.00	3.43
116	002714	牧原股份	1,523,028.00	3.42
117	601088	中国神华	1,519,418.00	3.41
118	600276	恒瑞医药	1,517,274.00	3.41
119	603185	上机数控	1,493,820.00	3.36
120	601919	中远海控	1,492,206.80	3.35
121	688221	前沿生物	1,485,347.60	3.34
122	688298	东方生物	1,482,400.44	3.33
123	688202	美迪西	1,481,483.57	3.33
124	688008	澜起科技	1,475,438.38	3.32
125	600280	中央商场	1,467,233.00	3.30
126	601166	兴业银行	1,466,047.00	3.29
127	688359	三孚新科	1,465,692.11	3.29
128	605117	德业股份	1,462,314.00	3.29
129	601989	中国重工	1,450,498.00	3.26
130	300550	和仁科技	1,441,397.00	3.24
131	600031	三一重工	1,438,292.00	3.23
132	688707	振华新材	1,426,697.71	3.21
133	002146	荣盛发展	1,417,564.00	3.19
134	601888	中国中免	1,417,543.00	3.18
135	002008	大族激光	1,413,195.50	3.18
136	603777	来伊份	1,394,842.00	3.13
137	002965	祥鑫科技	1,385,923.00	3.11
138	601966	玲珑轮胎	1,372,983.50	3.08
139	600011	华能国际	1,368,939.00	3.08

140	601688	华泰证券	1,351,424.00	3.04
141	002446	盛路通信	1,343,768.00	3.02
142	600019	宝钢股份	1,339,536.72	3.01
143	002233	塔牌集团	1,339,400.00	3.01
144	601390	中国中铁	1,335,429.00	3.00
145	600522	中天科技	1,334,443.00	3.00
146	603658	安图生物	1,331,070.00	2.99
147	688696	极米科技	1,330,096.51	2.99
148	600050	中国联通	1,324,142.00	2.98
149	300765	新诺威	1,321,708.00	2.97
150	300712	永福股份	1,321,439.00	2.97
151	300450	先导智能	1,320,022.00	2.97
152	002271	东方雨虹	1,319,369.00	2.96
153	002125	湘潭电化	1,313,355.00	2.95
154	603876	鼎胜新材	1,311,629.00	2.95
155	000157	中联重科	1,310,742.00	2.95
156	600029	南方航空	1,306,528.00	2.94
157	002050	三花智控	1,304,050.00	2.93
158	601229	上海银行	1,301,497.00	2.92
159	002707	众信旅游	1,286,804.00	2.89
160	000069	华侨城 A	1,282,635.00	2.88
161	000913	钱江摩托	1,272,301.00	2.86
162	688072	拓荆科技	1,267,874.10	2.85
163	600795	国电电力	1,258,431.00	2.83
164	002202	金风科技	1,248,149.00	2.80
165	688103	国力股份	1,244,983.75	2.80
166	300487	蓝晓科技	1,230,562.00	2.76
167	300212	易华录	1,217,882.00	2.74
168	002044	美年健康	1,216,539.00	2.73
169	300772	运达股份	1,214,725.00	2.73
170	000933	神火股份	1,211,897.00	2.72
171	688617	惠泰医疗	1,206,056.47	2.71
172	000733	振华科技	1,198,975.00	2.69
173	002324	普利特	1,194,644.00	2.68
174	000819	岳阳兴长	1,189,660.00	2.67
175	601111	中国国航	1,183,266.00	2.66
176	002869	金溢科技	1,181,633.00	2.65
177	600848	上海临港	1,180,320.00	2.65
178	603609	禾丰股份	1,171,567.00	2.63
179	002422	科伦药业	1,171,199.00	2.63
180	002897	意华股份	1,169,905.00	2.63
181	601799	星宇股份	1,168,977.00	2.63
182	688319	欧林生物	1,168,632.56	2.63

183	002068	黑猫股份	1,163,771.00	2.61
184	600426	华鲁恒升	1,163,501.00	2.61
185	600188	兖矿能源	1,156,914.00	2.60
186	603486	科沃斯	1,153,073.00	2.59
187	600353	旭光电子	1,152,307.00	2.59
188	600478	科力远	1,149,209.00	2.58
189	002748	世龙实业	1,147,103.00	2.58
190	688239	航宇科技	1,146,490.01	2.58
191	600766	园城黄金	1,146,033.00	2.57
192	688122	西部超导	1,145,175.82	2.57
193	300855	图南股份	1,133,163.00	2.55
194	603990	麦迪科技	1,131,377.00	2.54
195	300316	晶盛机电	1,124,410.00	2.53
196	688068	热景生物	1,123,205.57	2.52
197	601100	恒立液压	1,113,877.00	2.50
198	688295	中复神鹰	1,099,021.02	2.47
199	000800	一汽解放	1,097,513.00	2.47
200	000807	云铝股份	1,093,875.00	2.46
201	000617	中油资本	1,093,722.00	2.46
202	002306	中科云网	1,090,283.00	2.45
203	601877	正泰电器	1,086,464.00	2.44
204	002415	海康威视	1,080,440.00	2.43
205	002049	紫光国微	1,078,937.00	2.42
206	688560	明冠新材	1,066,295.93	2.40
207	300573	兴齐眼药	1,064,853.00	2.39
208	688516	奥特维	1,064,540.50	2.39
209	600521	华海药业	1,048,859.00	2.36
210	600009	上海机场	1,042,606.00	2.34
211	000159	国际实业	1,038,200.00	2.33
212	688200	华峰测控	1,034,871.41	2.33
213	000661	长春高新	1,033,731.00	2.32
214	000415	渤海租赁	1,033,099.00	2.32
215	300260	新莱应材	1,032,257.00	2.32
216	002459	晶澳科技	1,026,150.00	2.31
217	601899	紫金矿业	1,025,985.00	2.31
218	000970	中科三环	1,025,460.00	2.30
219	002368	太极股份	1,016,053.00	2.28
220	603489	八方股份	1,013,942.00	2.28
221	300416	苏试试验	1,008,810.00	2.27
222	600557	康缘药业	1,008,791.00	2.27
223	300628	亿联网络	1,008,687.00	2.27
224	600801	华新水泥	1,006,251.00	2.26
225	002847	盐津铺子	990,681.00	2.23

226	605266	健之佳	979,169.00	2.20
227	603811	诚意药业	979,058.00	2.20
228	000629	钒钛股份	978,276.00	2.20
229	603822	嘉澳环保	975,606.00	2.19
230	300820	英杰电气	975,330.00	2.19
231	300268	佳沃食品	974,053.00	2.19
232	603306	华懋科技	973,397.00	2.19
233	688201	信安世纪	972,374.04	2.18
234	600570	恒生电子	969,311.00	2.18
235	002785	万里石	967,682.00	2.17
236	600606	绿地控股	967,545.00	2.17
237	300532	今天国际	967,051.00	2.17
238	605377	华旺科技	956,924.00	2.15
239	600780	通宝能源	956,739.00	2.15
240	600246	万通发展	950,642.00	2.14
241	600406	国电南瑞	950,017.00	2.13
242	000301	东方盛虹	947,738.00	2.13
243	300724	捷佳伟创	946,012.00	2.13
244	605020	永和股份	943,114.00	2.12
245	603800	道森股份	939,572.00	2.11
246	002074	国轩高科	935,985.00	2.10
247	603399	吉翔股份	933,980.00	2.10
248	300203	聚光科技	930,941.00	2.09
249	600186	莲花健康	927,783.00	2.08
250	688700	东威科技	924,900.28	2.08
251	002920	德赛西威	924,193.00	2.08
252	000736	中交地产	922,199.00	2.07
253	002468	申通快递	910,227.00	2.05
254	002812	恩捷股份	906,646.34	2.04
255	002157	正邦科技	904,908.00	2.03
256	300171	东富龙	900,432.10	2.02
257	000519	中兵红箭	899,572.00	2.02
258	688278	特宝生物	899,512.20	2.02
259	600271	航天信息	897,113.00	2.02
260	002088	鲁阳节能	896,242.00	2.01
261	600197	伊力特	896,079.00	2.01
262	600809	山西汾酒	891,045.00	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。

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	300750	宁德时代	7,339,070.00	16.49

2	300274	阳光电源	7,237,323.00	16.26
3	600519	贵州茅台	5,018,439.00	11.28
4	002466	天齐锂业	4,311,948.00	9.69
5	002241	歌尔股份	4,207,863.00	9.45
6	000858	五粮液	4,136,561.00	9.29
7	600585	海螺水泥	3,812,337.00	8.57
8	600036	招商银行	3,809,390.00	8.56
9	688599	天合光能	3,712,444.03	8.34
10	601318	中国平安	3,576,608.99	8.04
11	000333	美的集团	3,456,124.99	7.77
12	688111	金山办公	3,455,531.96	7.76
13	600111	北方稀土	3,193,656.00	7.18
14	002821	凯莱英	3,176,253.20	7.14
15	601186	中国铁建	3,115,318.00	7.00
16	002459	晶澳科技	3,110,073.00	6.99
17	300035	中科电气	3,087,770.00	6.94
18	601985	中国核电	3,076,670.00	6.91
19	300122	智飞生物	3,070,852.00	6.90
20	300769	德方纳米	2,988,456.40	6.71
21	002865	钧达股份	2,915,159.00	6.55
22	300595	欧普康视	2,839,693.70	6.38
23	002475	立讯精密	2,838,491.00	6.38
24	000100	TCL 科技	2,831,222.00	6.36
25	600309	万华化学	2,813,233.00	6.32
26	300142	沃森生物	2,796,199.00	6.28
27	600900	长江电力	2,774,694.00	6.23
28	002709	天赐材料	2,695,494.00	6.06
29	001289	龙源电力	2,683,613.00	6.03
30	601975	招商南油	2,680,921.40	6.02
31	000725	京东方 A	2,649,789.00	5.95
32	002371	北方华创	2,643,954.23	5.94
33	000625	长安汽车	2,632,904.96	5.92
34	601012	隆基绿能	2,602,719.00	5.85
35	603613	国联股份	2,595,099.50	5.83
36	002329	皇氏集团	2,581,449.00	5.80
37	603260	合盛硅业	2,564,824.00	5.76
38	603501	韦尔股份	2,546,813.38	5.72
39	300014	亿纬锂能	2,519,836.00	5.66
40	600089	特变电工	2,486,304.00	5.59
41	600905	三峡能源	2,438,623.00	5.48
42	688032	禾迈股份	2,429,998.07	5.46
43	688561	奇安信	2,384,776.28	5.36
44	603606	东方电缆	2,330,259.00	5.24

45	601618	中国中冶	2,304,230.00	5.18
46	300465	高伟达	2,241,239.00	5.04
47	601988	中国银行	2,178,051.00	4.89
48	601800	中国交建	2,159,029.00	4.85
49	000792	盐湖股份	2,152,281.00	4.84
50	601169	北京银行	2,122,602.12	4.77
51	688036	传音控股	2,118,824.35	4.76
52	600438	通威股份	2,116,391.00	4.76
53	000977	浪潮信息	2,106,492.00	4.73
54	300601	康泰生物	2,081,077.80	4.68
55	002594	比亚迪	2,067,029.00	4.64
56	601600	中国铝业	2,060,105.00	4.63
57	300518	盛讯达	2,050,800.20	4.61
58	688063	派能科技	2,017,777.26	4.53
59	300059	东方财富	2,012,753.60	4.52
60	601288	农业银行	1,978,898.00	4.45
61	603259	药明康德	1,975,048.00	4.44
62	300760	迈瑞医疗	1,949,717.00	4.38
63	688408	中信博	1,943,207.05	4.37
64	601398	工商银行	1,932,400.00	4.34
65	300782	卓胜微	1,930,859.00	4.34
66	688390	固德威	1,928,642.38	4.33
67	000338	潍柴动力	1,927,355.00	4.33
68	002460	赣锋锂业	1,914,839.00	4.30
69	000596	古井贡酒	1,904,127.00	4.28
70	002731	萃华珠宝	1,899,739.00	4.27
71	300498	温氏股份	1,882,328.00	4.23
72	600436	片仔癀	1,873,803.00	4.21
73	600018	上港集团	1,871,786.00	4.21
74	002585	双星新材	1,842,390.00	4.14
75	002129	TCL 中环	1,836,978.00	4.13
76	603993	洛阳钼业	1,829,379.00	4.11
77	002192	融捷股份	1,821,443.00	4.09
78	002756	永兴材料	1,816,826.00	4.08
79	002791	坚朗五金	1,798,212.00	4.04
80	603398	沐邦高科	1,783,361.00	4.01
81	002531	天顺风能	1,782,889.00	4.01
82	603392	万泰生物	1,775,344.00	3.99
83	600536	中国软件	1,758,412.00	3.95
84	603799	华友钴业	1,751,356.55	3.93
85	601633	长城汽车	1,739,472.00	3.91
86	000768	中航西飞	1,731,799.00	3.89
87	603595	东尼电子	1,720,788.55	3.87

88	688091	上海谊众	1,700,099.70	3.82
89	300705	九典制药	1,675,381.00	3.76
90	601857	中国石油	1,659,486.00	3.73
91	002352	顺丰控股	1,642,751.00	3.69
92	600522	中天科技	1,639,327.00	3.68
93	601336	新华保险	1,602,399.00	3.60
94	001979	招商蛇口	1,601,311.00	3.60
95	300850	新强联	1,601,235.00	3.60
96	300316	晶盛机电	1,591,229.00	3.58
97	600276	恒瑞医药	1,585,564.00	3.56
98	600028	中国石化	1,585,399.00	3.56
99	002714	牧原股份	1,581,681.00	3.55
100	601668	中国建筑	1,577,764.00	3.54
101	000656	金科股份	1,555,867.00	3.50
102	300550	和仁科技	1,540,074.00	3.46
103	600745	闻泰科技	1,538,033.00	3.46
104	603605	珀莱雅	1,524,655.00	3.43
105	600406	国电南瑞	1,509,193.00	3.39
106	300712	永福股份	1,487,746.00	3.34
107	002812	恩捷股份	1,486,516.00	3.34
108	002179	中航光电	1,484,447.00	3.34
109	601162	天风证券	1,484,317.00	3.34
110	600763	通策医疗	1,464,632.00	3.29
111	601966	玲珑轮胎	1,444,141.00	3.24
112	002837	英维克	1,438,302.00	3.23
113	601166	兴业银行	1,435,386.00	3.23
114	300910	瑞丰新材	1,433,401.00	3.22
115	601888	中国中免	1,432,089.00	3.22
116	600050	中国联通	1,431,542.00	3.22
117	002943	宇晶股份	1,428,762.00	3.21
118	002738	中矿资源	1,424,519.00	3.20
119	601989	中国重工	1,422,806.00	3.20
120	002707	众信旅游	1,410,325.00	3.17
121	688202	美迪西	1,408,585.81	3.16
122	002965	祥鑫科技	1,408,062.00	3.16
123	603777	来伊份	1,391,401.00	3.13
124	300450	先导智能	1,387,235.00	3.12
125	688696	极米科技	1,378,719.67	3.10
126	600011	华能国际	1,374,781.00	3.09
127	601919	中远海控	1,351,447.08	3.04
128	601390	中国中铁	1,349,549.00	3.03
129	688072	拓荆科技	1,334,909.78	3.00
130	600416	湘电股份	1,334,761.00	3.00

131	688598	金博股份	1,332,293.00	2.99
132	300855	图南股份	1,330,111.00	2.99
133	002271	东方雨虹	1,325,711.00	2.98
134	002233	塔牌集团	1,309,673.00	2.94
135	002008	大族激光	1,303,723.00	2.93
136	000157	中联重科	1,301,434.00	2.92
137	600031	三一重工	1,293,929.00	2.91
138	688359	三孚新科	1,282,366.00	2.88
139	002068	黑猫股份	1,275,332.00	2.87
140	000819	岳阳兴长	1,272,961.88	2.86
141	002202	金风科技	1,260,493.00	2.83
142	603658	安图生物	1,255,307.00	2.82
143	300212	易华录	1,252,862.00	2.81
144	600999	招商证券	1,248,214.00	2.80
145	300487	蓝晓科技	1,236,473.00	2.78
146	300073	当升科技	1,230,605.00	2.76
147	002125	湘潭电化	1,227,419.00	2.76
148	002841	视源股份	1,225,767.00	2.75
149	600478	科力远	1,223,557.00	2.75
150	603985	恒润股份	1,216,579.00	2.73
151	002050	三花智控	1,212,563.00	2.72
152	600029	南方航空	1,210,884.00	2.72
153	600886	国投电力	1,209,636.00	2.72
154	002044	美年健康	1,206,586.00	2.71
155	603283	赛腾股份	1,204,369.00	2.71
156	601799	星宇股份	1,203,658.00	2.70
157	000933	神火股份	1,188,577.00	2.67
158	000069	华侨城 A	1,187,760.00	2.67
159	000800	一汽解放	1,186,499.00	2.67
160	688122	西部超导	1,175,810.02	2.64
161	600848	上海临港	1,174,753.00	2.64
162	601100	恒立液压	1,166,547.00	2.62
163	603609	禾丰股份	1,163,396.00	2.61
164	600426	华鲁恒升	1,160,746.00	2.61
165	688560	明冠新材	1,149,283.01	2.58
166	600766	园城黄金	1,144,145.00	2.57
167	688617	惠泰医疗	1,140,445.18	2.56
168	002634	棒杰股份	1,139,705.00	2.56
169	300772	运达股份	1,135,868.00	2.55
170	300777	中简科技	1,134,831.00	2.55
171	601111	中国国航	1,133,760.00	2.55
172	002306	中科云网	1,123,903.00	2.53
173	603990	麦迪科技	1,121,231.50	2.52

174	688123	聚辰股份	1,114,092.20	2.50
175	603185	上机数控	1,111,610.00	2.50
176	002049	紫光国微	1,110,014.00	2.49
177	688516	奥特维	1,106,538.98	2.49
178	000002	万科 A	1,105,019.00	2.48
179	002897	意华股份	1,102,396.00	2.48
180	601877	正泰电器	1,100,860.00	2.47
181	002415	海康威视	1,098,689.00	2.47
182	600399	抚顺特钢	1,096,595.00	2.46
183	688319	欧林生物	1,087,169.46	2.44
184	600893	航发动力	1,082,992.00	2.43
185	603486	科沃斯	1,077,484.00	2.42
186	600481	双良节能	1,053,957.00	2.37
187	002324	普利特	1,052,851.00	2.37
188	002748	世龙实业	1,050,378.00	2.36
189	600801	华新水泥	1,050,001.00	2.36
190	601899	紫金矿业	1,046,502.00	2.35
191	600152	维科技术	1,037,885.00	2.33
192	000629	钒钛股份	1,010,440.00	2.27
193	300628	亿联网络	1,008,632.00	2.27
194	300268	佳沃食品	1,006,602.00	2.26
195	000807	云铝股份	1,002,751.00	2.25
196	300573	兴齐眼药	999,099.00	2.24
197	600606	绿地控股	998,005.00	2.24
198	300049	福瑞股份	989,907.00	2.22
199	000661	长春高新	982,919.00	2.21
200	000970	中科三环	978,406.00	2.20
201	688005	容百科技	975,709.52	2.19
202	600009	上海机场	966,216.00	2.17
203	605117	德业股份	957,700.00	2.15
204	600570	恒生电子	952,634.00	2.14
205	300416	苏试试验	947,645.04	2.13
206	688388	嘉元科技	946,937.21	2.13
207	600809	山西汾酒	945,958.00	2.13
208	300724	捷佳伟创	944,440.00	2.12
209	600197	伊力特	943,011.00	2.12
210	002157	正邦科技	940,268.00	2.11
211	600760	中航沈飞	939,659.00	2.11
212	000301	东方盛虹	937,836.00	2.11
213	600557	康缘药业	934,420.00	2.10
214	300260	新莱应材	927,452.00	2.08
215	300896	爱美客	916,850.00	2.06
216	300171	东富龙	913,825.00	2.05

217	688700	东威科技	913,806.64	2.05
218	603489	八方股份	913,424.00	2.05
219	688201	信安世纪	911,738.86	2.05
220	000063	中兴通讯	911,173.00	2.05
221	002920	德赛西威	909,172.00	2.04
222	300763	锦浪科技	907,889.00	2.04
223	300395	菲利华	907,486.00	2.04
224	000736	中交地产	903,184.00	2.03
225	603399	吉翔股份	902,889.00	2.03
226	002468	申通快递	900,661.23	2.02
227	002603	以岭药业	900,642.00	2.02
228	600588	用友网络	895,726.00	2.01
229	300505	川金诺	891,630.00	2.00
230	300565	科信技术	891,398.00	2.00
231	688185	康希诺	890,653.14	2.00
232	002529	海源复材	890,524.00	2.00

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	703,575,749.69
卖出股票收入（成交）总额	659,594,169.76

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

太极计算机股份有限公司

太极计算机股份有限公司因违反税收管理规定和未依法履行职责被国家税务总局横琴粤澳深度合作区税务局和国家税务总局上海市嘉定区税务局责令整改。

山西通宝能源股份有限公司

2022 年 6 月 14 日，山西通宝能源股份有限公司因财务会计报告违规，被上海证券交易所上市公司管理一部予以监管警示。

除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	98,476.93
2	应收清算款	1,859,517.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,101.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,974,096.10

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

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（%）
德邦量化优选股票 A	856	29,863.64	6,936,810.51	27.14	18,626,468.11	72.86
德邦量化优选股票 C	1,429	31,902.79	16,221,243.47	35.58	29,367,847.22	64.42
合计	2,285	31,138.89	23,158,053.98	32.55	47,994,315.33	67.45

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	德邦量化优选股票 A	1,732.08	0.0068
	德邦量化优选股票 C	544,740.62	1.1949
	合计	546,472.70	0.7680

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	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	德邦量化优选股票 A	—
	德邦量化优选股票 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	德邦量化优选股票 A	—
	德邦量化优选股票 C	50~100
	合计	50~100

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情况

注：无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
基金合同生效日 (2017 年 3 月 24 日) 基金份额总额	86,793,545.80	114,236,860.64
本报告期期初基金份额总额	6,973,985.45	23,410,062.57
本报告期基金总申购份额	24,063,463.56	60,050,819.67
减：本报告期基金总赎回份额	5,474,170.39	37,871,791.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	25,563,278.62	45,589,090.69

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。

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2022 年 6 月 18 日公告，李荣兴先生担任本基金基金经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼。

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 4.5 万元整，该审计机构自基金合同生效日（2017 年 3 月 24 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：无相关情况。

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 (%)	
兴业证券	2	864,234,094.05	63.40	423,214.96	50.01	—
国泰君安证券	2	290,484,907.47	21.31	270,529.48	31.97	—
大通证券	1	133,995,995.73	9.83	97,982.96	11.58	—
光大证券	2	74,454,922.20	5.46	54,449.32	6.43	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—

广发证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	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
- (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，本基金减少租用光大证券的交易单元。

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(%)
兴业证券	300,150.00	100.00	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

德邦证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
广州证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

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	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 2021 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 1 月 21 日
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	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告	中国证监会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	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 2022 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 4 月 22 日
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	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加攀赢基金为销售机构的公告	中国证监会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

25	德邦基金管理有限公司关于德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）增加中正达广为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 6 月 16 日
26	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 6 月 18 日
27	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
28	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金在申万宏源证券及申万宏源西部证券调整申购、定期定额投资业务最低限额的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 6 月 22 日
29	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
30	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
31	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）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
32	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
33	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 22 日
34	关于德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 8 月 13 日
35	德邦基金管理有限公司关于德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）增加华林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 16 日
36	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
37	关于德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 8 月 26 日
38	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）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
39	德邦量化优选股票型证券投资基金	中国证监会基金电子披	2022 年 8 月 31 日

	(LOF)(德邦量化优选股票 C 类份额)基金产品资料概要更新	露网站及基金管理人网站	
40	关于德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)可能触发基金合同终止情形的提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2022 年 9 月 2 日
41	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
42	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
43	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
44	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
45	德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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
51	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	2022 年 12 月 29 日

§ 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	20220101-20221231	16,221,243.47	-	-	16,221,243.47	22.8000
产品特有风险							
1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响； 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动； 4、单一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； 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； 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、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

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

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