

德邦量化优选股票型证券投资基金
(LOF)
2023 年年度报告

2023 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：2024 年 03 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 2024 年 3 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。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50

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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65
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	65
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	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
8.14 投资组合报告附注	65
§ 9 基金份额持有人信息	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末上市基金前十名持有人	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.4 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	67
9.5 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	68
§ 10 开放式基金份额变动	68
§ 11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	75

§ 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	德邦量化优选股票（LOF）	
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	89,734,682.85份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	2017年3月24日	
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	27,295,334.63份	62,439,348.22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%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		德邦基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐晓红	帅芳
	联系电话	021-26010852	021-38031815
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com

客户服务电话	4008217788	021-38917599-5
传真	021-26010808	021-38677819
注册地址	上海市虹口区东大名路 501 号 503B 单元	中国（上海）自由贸易试验区 商城路 618 号
办公地址	上海市杨浦区荆州路 198 号万硕 大厦 A 栋 25 楼	上海市静安区新闻路 669 号博 华广场 19 楼
邮政编码	200082	200041
法定代表人	左畅	朱健

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	2023 年		2022 年		2021 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	- 1,527,837 .41	- 1,904,717 .43	- 1,918,936 .02	- 5,452,020 .64	754,808.1 1	1,887,333 .20
本期利润	- 432,815.3 2	187,574.9 9	- 2,770,271 .48	- 6,563,878 .85	- 598,092.9 7	- 1,199,524 .00
加权平均 基金份额 本期利润	-0.0192	0.0051	-0.2407	-0.2352	-0.0926	-0.0542
本期加权 平均净值 利润率	-1.51%	0.41%	-18.61%	-18.66%	-5.75%	-3.45%
本期基金 份额净值 增长率	-0.68%	-0.92%	-15.53%	-15.74%	-8.61%	-8.84%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	期末可供分配利润	6,825,690.67	13,522,417.86	6,609,568.35	10,390,707.08	3,416,944.17
期末可供分配基金份额利润	0.2501	0.2166	0.2586	0.2279	0.4900	0.4573
期末基金资产净值	34,121,025.30	75,961,766.08	32,172,846.97	55,979,797.77	10,390,929.62	34,116,272.71
期末基金份额净值	1.2501	1.2166	1.2586	1.2279	1.4900	1.4573
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	基金份额累计净值增长率	42.55%	39.06%	43.52%	40.35%	69.91%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦量化优选股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.45%	0.97%	-6.65%	0.75%	10.10%	0.22%
过去六个月	-3.33%	0.89%	-10.17%	0.81%	6.84%	0.08%
过去一年	-0.68%	0.81%	-10.79%	0.80%	10.11%	0.01%
过去三年	-23.33%	1.18%	-32.59%	1.06%	9.26%	0.12%
过去五年	50.63%	1.21%	13.81%	1.15%	36.82%	0.06%

自基金合同生效起至今	42.55%	1.17%	-0.18%	1.12%	42.73%	0.05%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

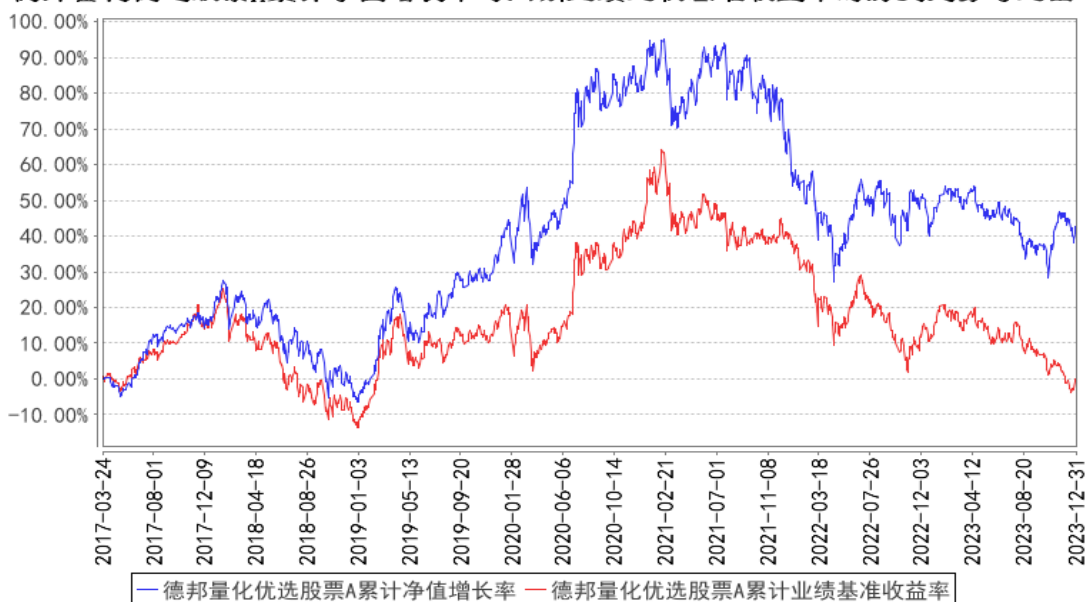
德邦量化优选股票 C

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	3.38%	0.97%	-6.65%	0.75%	10.03%	0.22%
过去六个月	-3.45%	0.89%	-10.17%	0.81%	6.72%	0.08%
过去一年	-0.92%	0.81%	-10.79%	0.80%	9.87%	0.01%
过去三年	-23.90%	1.18%	-32.59%	1.06%	8.69%	0.12%
过去五年	48.65%	1.21%	13.81%	1.15%	34.84%	0.06%
自基金合同生效起至今	39.06%	1.17%	-0.18%	1.12%	39.24%	0.05%

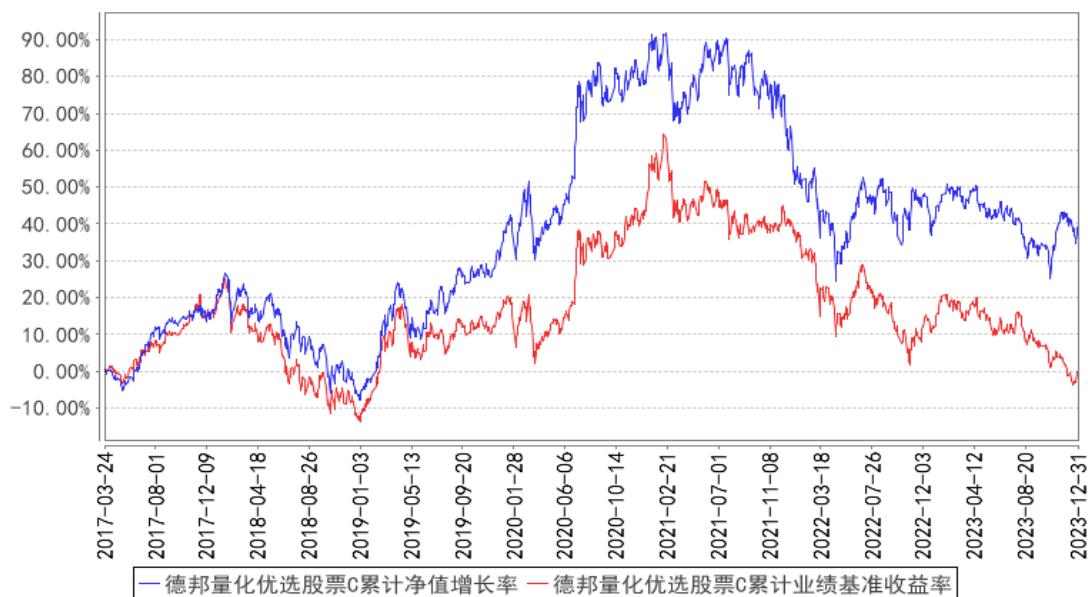
注：本基金业绩比较基准：95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）

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



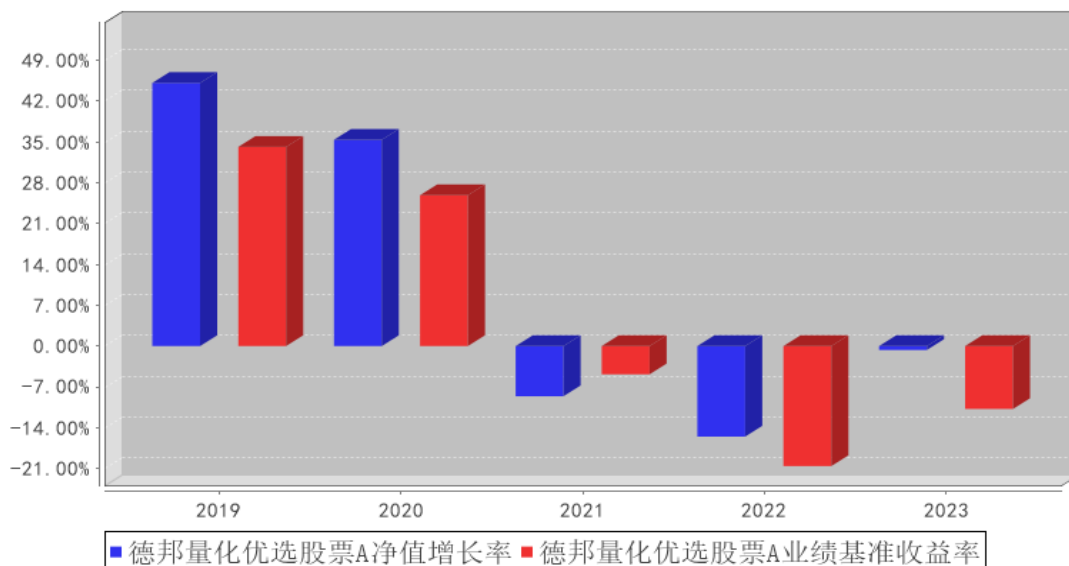
德邦量化优选股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



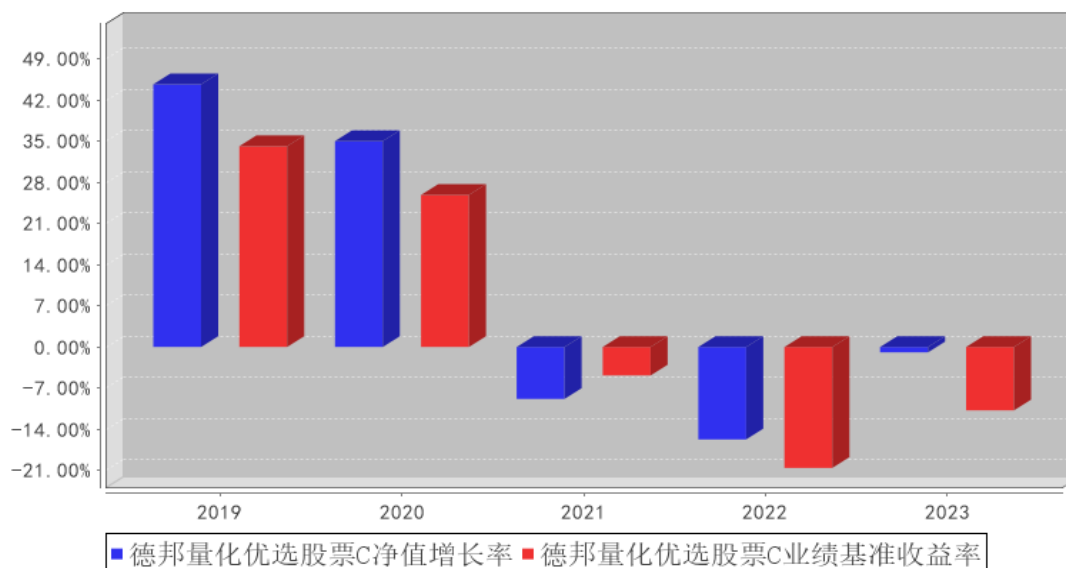
注：本基金的基金合同生效日为 2017 年 03 月 24 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满 1 年。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2017 年 03 月 24 日至 2023 年 12 月 31 日。

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

德邦量化优选股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



德邦量化优选股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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、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12月31日，本基金管理人共管理三十一只开放式基金：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		
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，现任公司基金经理。
吴志鹏	无	2021 年 6 月 29 日	2023 年 11 月 20 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。现任公司基金经理。

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：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。

4.3.3 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 2023 年下半年，全球经济复苏进程依然曲折，地缘政治紧张局势不断升级，而国内也面临着行业政策调整、自然灾害等多重挑战。在这样的背景下，A 股市场经历了显著的波动。中国经济总体保持了恢复态势，但增速略有放缓。杭州亚运会的举办对旅游、餐饮、零售等相关行业产生了显著的拉动效应。上证指数在多重因素的影响下出现了明显的波动。尽管面临诸多不利因素，市场流动性依然保持充裕，为市场的稳定提供了重要支撑。在经历了一段时间的调整后，市场在找到平衡点后逐渐开启了反弹行情。在这轮反弹中，中小市值板块表现出较强的韧性，尤其是具备成长潜力和创新能力的企业。

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 1.2501 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-10.79%；德邦量化优选股票 C 基金份额净值为 1.2166 元，基金份额净值增长率为-0.92%，同期业绩比较基准收益率为-10.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年上半年，全球经济预计将继续呈现复苏态势，但增速可能因各种不确定性因素而有所放缓。中国经济有望在政策支持和内需拉动的共同作用下保持稳定增长。政策方面，各国政府可能会继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，以应对经济增长放缓和通胀压力。同时，加强国际合作，推动全球经济治理体系的完善也将成为重要议题。在宏观经济复苏和政策支持的背景下，2024 年上半年证券市场有望呈现震荡上行的态势。投资者信心可能逐渐恢复，市场流动性保持充裕。然而，市场波动可能加大，具体来看，发达国家市场可能面临货币政策收紧和经济增长放缓的双重压力，新兴市场则可能受益于全球经济复苏和资本流入。中国证券市场有望在政策引导和内需拉动的共同作用下保持稳定表现，但市场分化可能加剧，需要关注结构性机会。

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，2023 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。2023 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权益的合规管理要求。风险管理方面，2023 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，2023 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，2023 年，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续加强内部合规控制、风险管理以及稽核审计工作，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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（2024）审字第 70066381_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	<p>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 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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）2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>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。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估德邦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。</p> <p>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。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判</p>

	<p>断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能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。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔺育化 徐雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2024年3月29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：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	1,032,526.68	8,264,591.53
结算备付金		107,688.93	582,384.19
存出保证金		5,664,421.19	98,476.93

交易性金融资产	7.4.7.2	99,752,024.74	78,036,402.08
其中：股票投资		99,752,024.74	78,036,402.08
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
应收股利		-	-
应收申购款		4,710,859.26	16,101.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	194.44	-
资产总计		111,267,715.24	88,857,473.90
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		826,578.05	231,925.07
应付管理人报酬		74,817.77	66,898.06
应付托管费		14,963.56	13,379.59
应付销售服务费		12,275.46	10,575.90
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	256,289.02	382,050.54
负债合计		1,184,923.86	704,829.16
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	89,734,682.85	71,152,369.31
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	20,348,108.53	17,000,275.43
净资产合计		110,082,791.38	88,152,644.74

负债和净资产总计		111,267,715.24	88,857,473.90
----------	--	----------------	---------------

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，德邦量化优选股票 A 基金份额净值 1.2501 元，基金份额总额 27,295,334.63 份；德邦量化优选股票 C 基金份额净值 1.2166 元，基金份额总额 62,439,348.22 份。德邦量化优选股票（LOF）份额总额合计 89,734,682.85 份。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		910,311.04	-8,525,764.39
1. 利息收入		60,497.10	97,046.32
其中：存款利息收入	7.4.7.13	60,302.66	97,046.32
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		-	-
其他利息收入		194.44	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,535,875.77	-6,779,121.17
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-3,440,169.99	-7,152,938.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	18,423.03	962.03
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-414,864.10
股利收益	7.4.7.19	885,871.19	787,719.08
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	3,187,314.51	-1,963,193.67
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	198,375.20	119,504.13
减：二、营业总支出		1,155,551.37	808,385.94

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	741,089.27	497,275.34
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	148,217.88	99,455.02
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	113,744.05	87,655.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.17	-
8. 其他费用	7.4.7.23	152,500.00	124,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-245,240.33	-9,334,150.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-245,240.33	-9,334,150.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-245,240.33	-9,334,150.33

7.3 净资产变动表

会计主体：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	71,152,369.31	-	17,000,275.43	88,152,644.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	71,152,369.31	-	17,000,275.43	88,152,644.74
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	18,582,313.54	-	3,347,833.10	21,930,146.64
（一）、综合收益总额	-	-	-245,240.33	-245,240.33
（二）、本期基金份额交易产生的	18,582,313.54	-	3,593,073.43	22,175,386.97

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	91,971,896.89	-	23,436,947.71	115,408,844.60
2. 基金赎 回款	-73,389,583.35	-	-19,843,874.28	-93,233,457.63
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	89,734,682.85	-	20,348,108.53	110,082,791.38
项目	上年度可比期间 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	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	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 份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	40,768,321.29	-	12,211,271.45	52,979,592.74
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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	71,152,369.31	-	17,000,275.43	88,152,644.74

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%×沪深 300 指数收益率+5%×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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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

本基金本报告期无会计政策变更。

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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

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。

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	1,032,526.68	8,264,591.53
等于：本金	1,032,019.38	8,260,636.55
加：应计利息	507.30	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	1,032,526.68	8,264,591.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	99,579,757.59	-	99,752,024.74	172,267.15
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	99,579,757.59	-	99,752,024.74	172,267.15
项目	上年度末 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

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

本基金本报告期末及上年度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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	194.44	-
待摊费用	-	-
合计	194.44	-

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,789.02	107.30
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	136,943.24
其中：交易所市场	-	136,943.24
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付信息披露费	200,000.00	200,000.00
应付审计费	50,000.00	45,000.00
应付账户维护费	4,500.00	-
合计	256,289.02	382,050.54

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,563,278.62	25,563,278.62
本期申购	31,592,265.27	31,592,265.27
本期赎回（以“-”号填列）	-29,860,209.26	-29,860,209.26
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	27,295,334.63	27,295,334.63

德邦量化优选股票 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,589,090.69	45,589,090.69
本期申购	60,379,631.62	60,379,631.62

本期赎回（以“-”号填列）	-43,529,374.09	-43,529,374.09
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	62,439,348.22	62,439,348.22

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
上年度末	14,729,390.17	-8,119,821.82	6,609,568.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,729,390.17	-8,119,821.82	6,609,568.35
本期利润	-1,527,837.41	1,095,022.09	-432,815.32
本期基金份额交易产生的变动数	1,260,403.72	-611,466.08	648,937.64
其中：基金申购款	18,250,963.23	-9,255,450.81	8,995,512.42
基金赎回款	-16,990,559.51	8,643,984.73	-8,346,574.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,461,956.48	-7,636,265.81	6,825,690.67

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
上年度末	24,569,007.14	-14,178,300.06	10,390,707.08
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	24,569,007.14	-14,178,300.06	10,390,707.08
本期利润	-1,904,717.43	2,092,292.42	187,574.99
本期基金份额交易产生的变动数	7,972,131.84	-5,027,996.05	2,944,135.79
其中：基金申购款	31,709,608.48	-17,268,173.19	14,441,435.29
基金赎回款	-23,737,476.64	12,240,177.14	-11,497,299.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,636,421.55	-17,114,003.69	13,522,417.86

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	37,309.42	85,608.49
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	12,165.01	9,949.72
其他	10,828.23	1,488.11
合计	60,302.66	97,046.32

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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,440,169.99	-7,152,938.18
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	-3,440,169.99	-7,152,938.18

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,096,385,864.99	659,594,169.76
减：卖出股票成本总额	1,097,259,381.76	665,130,136.02
减：交易费用	2,566,653.22	1,616,971.92
买卖股票差价收入	-3,440,169.99	-7,152,938.18

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 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	181.92	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	18,241.11	-150.30
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	18,423.03	962.03

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 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	391,834.56	306,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	370,116.00	300,150.00
减：应计利息总额	3,470.85	6,000.00
减：交易费用	6.60	0.30
买卖债券差价收入	18,241.11	-150.30

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	885,871.19	787,719.08
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	885,871.19	787,719.08
----	------------	------------

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	3,187,314.51	-1,963,193.67
股票投资	3,187,314.51	-1,963,193.67
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	3,187,314.51	-1,963,193.67

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	198,375.20	119,504.13
合计	198,375.20	119,504.13

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 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	50,000.00	35,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	22,500.00	9,000.00
合计	152,500.00	124,000.00

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

注：基金管理人于 2024 年 2 月 9 日发布公告，西子联合控股有限公司不再为本基金管理人的股东。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（%）
国泰君安证券	-	-	290,484,907.47	21.31

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 2023年1月1日至2023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 （%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-

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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	741,089.27	497,275.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	237,445.72	107,185.30
应支付基金管理人的净管理费	503,643.55	390,090.04

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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日

当期发生的基金应支付的托管费	148,217.88	99,455.02
----------------	------------	-----------

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	50,521.87	50,521.87
德邦证券	-	149.37	149.37
国泰君安	-	10.95	10.95
合计	-	50,682.19	50,682.19
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 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

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 2023年1月1日至2023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	3,045,263.09	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
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	11.1567%	-
项目	上年度可比期间 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	-	-
报告期内申购/买入总份额	3,045,263.09	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
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%	-

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 2023年12月31日		上年度末 2022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	32,871,260.12	52.6451	16,221,243.47	35.5814

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 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	1,032,526.68	37,309.42	8,264,591.53	85,608.49

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

本基金本报告期及上年度末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（2023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，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之内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

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

注：无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求

的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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							
货币资金	1,032,526.68	-	-	-	-	-	1,032,526.68
结算备付金	107,688.93	-	-	-	-	-	107,688.93
存出保证金	5,664,421.19	-	-	-	-	-	5,664,421.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	99,752,024.74	99,752,024.74
应收申购款	-	-	-	-	-	4,710,859.26	4,710,859.26
其他资产	-	-	-	-	-	194.44	194.44
资产总计	6,804,636.80	-	-	-	-	104,463,078.44	111,267,715.24
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	826,578.05	826,578.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	74,817.77	74,817.77
应付托管费	-	-	-	-	-	14,963.56	14,963.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	12,275.46	12,275.46
其他负债	-	-	-	-	-	256,289.02	256,289.02
负债总计	-	-	-	-	-	1,184,923.86	1,184,923.86
利率敏感度缺口	6,804,636.80	-	-	-	-	-103,278,154.58	110,082,791.38
上年度末 2022 年 12 月 31 日							
资产							
货币资金	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

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2023年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2022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（2022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 2023年12月31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	99,752,024.74	90.62	78,036,402.08	88.52

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	99,752,024.74	90.62	78,036,402.08	88.52

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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 上升 1%	795,578.08	756,525.52
	沪深 300 下降 1%	-795,578.08	-756,525.52

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	99,752,024.74	78,036,402.08
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	99,752,024.74	78,036,402.08

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

7.4.14.3 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 2024 年 3 月 29 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	99,752,024.74	89.65
	其中：股票	99,752,024.74	89.65
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	1,140,215.61	1.02
8	其他各项资产	10,375,474.89	9.32
9	合计	111,267,715.24	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	723,254.00	0.66
B	采矿业	829,934.00	0.75
C	制造业	70,161,283.24	63.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,445,247.00	1.31
E	建筑业	2,762,614.00	2.51
F	批发和零售业	3,632,130.00	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	2,134,103.00	1.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,906,074.00	9.00
J	金融业	400,038.00	0.36
K	房地产业	1,496,707.00	1.36
L	租赁和商务服务业	610,064.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	2,667,520.00	2.42
N	水利、环境和公共设施管理业	2,752,992.50	2.50

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	32,417.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	197,647.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	99,752,024.74	90.62

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	688683	莱尔科技	43,522	1,113,292.76	1.01
2	688517	金冠电气	63,200	997,928.00	0.91
3	688219	会通股份	86,400	947,808.00	0.86
4	300254	仟源医药	95,000	914,850.00	0.83
5	688193	仁度生物	20,200	911,424.00	0.83
6	301259	艾布鲁	54,500	900,885.00	0.82
7	000608	阳光股份	311,800	897,984.00	0.82
8	603790	雅运股份	62,800	879,828.00	0.80
9	688379	华光新材	43,400	858,018.00	0.78
10	688367	工大高科	47,200	842,048.00	0.76
11	300907	康平科技	36,400	807,716.00	0.73
12	603676	卫信康	72,300	754,089.00	0.69
13	688058	宝兰德	15,500	731,755.00	0.66
14	688031	星环科技	11,200	728,784.00	0.66
15	688312	燕麦科技	34,613	714,758.45	0.65
16	688391	钜泉科技	14,400	714,240.00	0.65
17	688081	兴图新科	39,700	683,237.00	0.62
18	688186	广大特材	37,059	667,803.18	0.61
19	002295	精艺股份	76,200	622,554.00	0.57
20	300929	华骐环保	50,600	615,802.00	0.56
21	688607	康众医疗	29,800	607,324.00	0.55
22	600802	福建水泥	115,200	596,736.00	0.54
23	688013	天臣医疗	26,900	567,590.00	0.52
24	688329	艾隆科技	22,800	566,808.00	0.51
25	688129	东来技术	33,900	561,045.00	0.51
26	688078	龙软科技	13,800	556,416.00	0.51
27	688045	必易微	12,900	552,507.00	0.50
28	605288	凯迪股份	11,400	537,168.00	0.49
29	603829	洛凯股份	32,700	533,991.00	0.49

30	000691	亚太实业	102,800	521,196.00	0.47
31	688090	瑞松科技	16,000	518,240.00	0.47
32	601101	昊华能源	81,600	515,712.00	0.47
33	300652	雷迪克	18,500	511,525.00	0.46
34	688227	品高股份	26,300	501,541.00	0.46
35	002871	伟隆股份	44,800	500,864.00	0.45
36	300689	澄天伟业	25,400	491,998.00	0.45
37	688511	天微电子	15,600	490,932.00	0.45
38	301070	开勒股份	10,900	488,974.00	0.44
39	000096	广聚能源	42,100	487,939.00	0.44
40	688282	理工导航	12,400	487,320.00	0.44
41	003042	中农联合	26,200	486,796.00	0.44
42	300771	智莱科技	44,600	484,802.00	0.44
43	603041	美思德	36,000	484,560.00	0.44
44	688267	中触媒	25,200	484,344.00	0.44
45	300721	怡达股份	32,400	483,732.00	0.44
46	002084	海鸥住工	119,800	476,804.00	0.43
47	688265	南模生物	12,400	476,780.00	0.43
48	300642	透景生命	27,000	476,550.00	0.43
49	603955	大千生态	32,400	475,956.00	0.43
50	605136	丽人丽妆	47,800	473,698.00	0.43
51	002082	万邦德	74,000	473,600.00	0.43
52	603776	永安行	33,600	473,088.00	0.43
53	300245	天玑科技	53,600	472,752.00	0.43
54	300086	康芝药业	80,400	471,948.00	0.43
55	000153	丰原药业	50,200	470,374.00	0.43
56	688655	迅捷兴	31,046	468,794.60	0.43
57	300149	睿智医药	61,200	468,180.00	0.43
58	002330	得利斯	82,200	457,032.00	0.42
59	002114	罗平锌电	60,700	454,036.00	0.41
60	603086	先达股份	76,100	447,468.00	0.41
61	301051	信濠光电	7,000	445,690.00	0.40
62	002412	汉森制药	63,800	432,564.00	0.39
63	002802	洪汇新材	32,900	421,449.00	0.38
64	688216	气派科技	15,000	415,050.00	0.38
65	300703	创源股份	36,700	412,508.00	0.37
66	002627	三峡旅游	76,700	409,578.00	0.37
67	300837	浙矿股份	13,600	406,232.00	0.37
68	688171	纬德信息	18,000	405,000.00	0.37
69	002365	永安药业	41,400	404,892.00	0.37
70	688098	申联生物	52,800	394,944.00	0.36
71	688466	金科环境	22,134	392,878.50	0.36
72	688793	倍轻松	11,600	390,340.00	0.35

73	002811	郑中设计	39,400	388,090.00	0.35
74	688108	赛诺医疗	30,600	384,030.00	0.35
75	002381	双箭股份	50,500	382,790.00	0.35
76	688021	奥福环保	18,201	379,490.85	0.34
77	603703	盛洋科技	29,200	374,052.00	0.34
78	603900	莱绅通灵	54,600	364,728.00	0.33
79	002688	金河生物	73,300	352,573.00	0.32
80	688332	中科蓝讯	4,600	346,932.00	0.32
81	300970	华绿生物	20,100	346,926.00	0.32
82	688501	青达环保	20,600	344,638.00	0.31
83	603798	康普顿	34,700	335,549.00	0.30
84	002290	禾盛新材	25,700	334,357.00	0.30
85	600281	华阳新材	71,700	332,688.00	0.30
86	300952	恒辉安防	15,200	331,056.00	0.30
87	300808	久量股份	21,200	330,296.00	0.30
88	002718	友邦吊顶	19,200	326,592.00	0.30
89	603045	福达合金	20,600	325,274.00	0.30
90	002891	中宠股份	12,300	324,105.00	0.29
91	300194	福安药业	73,600	322,368.00	0.29
92	002357	富临运业	42,600	321,630.00	0.29
93	603580	艾艾精工	21,300	317,157.00	0.29
94	688030	山石网科	15,800	316,316.00	0.29
95	603139	康惠制药	16,800	315,336.00	0.29
96	002198	嘉应制药	43,100	313,768.00	0.29
97	600538	国发股份	67,200	311,808.00	0.28
98	688244	永信至诚	5,500	306,845.00	0.28
99	002134	天津普林	27,900	306,063.00	0.28
100	300440	运达科技	40,400	300,980.00	0.27
101	000972	中基健康	84,700	300,685.00	0.27
102	003018	金富科技	28,200	300,330.00	0.27
103	688588	凌志软件	25,000	297,500.00	0.27
104	600488	津药药业	60,600	296,940.00	0.27
105	603709	中源家居	16,300	293,400.00	0.27
106	688095	福昕软件	4,100	286,385.00	0.26
107	688026	洁特生物	16,485	284,201.40	0.26
108	603316	诚邦股份	42,000	283,080.00	0.26
109	002973	侨银股份	25,800	283,026.00	0.26
110	600969	郴电国际	43,400	282,100.00	0.26
111	603238	诺邦股份	20,500	281,875.00	0.26
112	603657	春光科技	17,400	279,966.00	0.25
113	300980	祥源新材	11,900	279,174.00	0.25
114	603700	宁水集团	19,500	278,265.00	0.25
115	603333	尚纬股份	48,700	278,077.00	0.25

116	002321	华英农业	115,900	275,842.00	0.25
117	300818	耐普矿机	8,300	273,983.00	0.25
118	601996	丰林集团	93,900	267,615.00	0.24
119	300925	法本信息	22,500	264,375.00	0.24
120	002763	汇洁股份	31,400	264,074.00	0.24
121	688320	禾川科技	6,400	262,400.00	0.24
122	300920	润阳科技	12,300	258,915.00	0.24
123	688296	和达科技	14,100	253,377.00	0.23
124	603969	银龙股份	41,500	249,000.00	0.23
125	301199	迈赫股份	9,400	246,750.00	0.22
126	300126	锐奇股份	34,500	246,675.00	0.22
127	300932	三友联众	15,100	245,828.00	0.22
128	002830	名雕股份	16,500	245,685.00	0.22
129	688311	盟升电子	4,800	244,848.00	0.22
130	300669	沪宁股份	15,700	244,763.00	0.22
131	300486	东杰智能	35,400	244,614.00	0.22
132	002039	黔源电力	17,700	244,083.00	0.22
133	301063	海锅股份	10,700	243,960.00	0.22
134	002360	同德化工	33,400	243,820.00	0.22
135	301237	和顺科技	8,000	243,760.00	0.22
136	603978	深圳新星	14,700	243,726.00	0.22
137	003027	同兴环保	13,300	242,858.00	0.22
138	001212	中旗新材	10,200	242,352.00	0.22
139	002403	爱仕达	28,200	241,392.00	0.22
140	002685	华东重机	67,600	241,332.00	0.22
141	300778	新城市	17,700	240,720.00	0.22
142	605001	威奥股份	35,900	240,171.00	0.22
143	300616	尚品宅配	13,400	240,128.00	0.22
144	603878	武进不锈	31,800	240,090.00	0.22
145	300002	神州泰岳	27,100	239,835.00	0.22
146	002560	通达股份	33,200	239,704.00	0.22
147	300501	海顺新材	16,600	239,538.00	0.22
148	000545	金浦钛业	78,800	238,764.00	0.22
149	600826	兰生股份	27,000	238,680.00	0.22
150	002225	濮耐股份	63,000	238,140.00	0.22
151	000159	国际实业	36,600	237,534.00	0.22
152	300599	雄塑科技	29,600	237,392.00	0.22
153	002523	天桥起重	85,200	236,856.00	0.22
154	002496	辉丰股份	122,300	236,039.00	0.21
155	300414	中光防雷	24,500	235,935.00	0.21
156	002478	常宝股份	43,200	235,440.00	0.21
157	003016	欣贺股份	28,800	235,296.00	0.21
158	300069	金利华电	14,600	235,060.00	0.21

159	603843	正平股份	67,100	234,179.00	0.21
160	688578	艾力斯	5,600	233,296.00	0.21
161	002274	华昌化工	30,900	233,295.00	0.21
162	002910	庄园牧场	21,200	231,928.00	0.21
163	601963	重庆银行	33,300	231,768.00	0.21
164	600693	东百集团	57,100	228,971.00	0.21
165	603076	乐惠国际	8,500	227,800.00	0.21
166	688205	德科立	4,600	227,608.00	0.21
167	603815	交建股份	27,200	227,392.00	0.21
168	603221	爱丽家居	22,400	222,656.00	0.20
169	600983	惠而浦	24,800	220,472.00	0.20
170	301079	邵阳液压	12,700	219,710.00	0.20
171	600269	赣粤高速	53,400	219,474.00	0.20
172	603928	兴业股份	16,000	213,920.00	0.19
173	000969	安泰科技	23,300	209,467.00	0.19
174	600572	康恩贝	41,100	207,555.00	0.19
175	605003	众望布艺	10,500	207,270.00	0.19
176	603222	济民医疗	25,700	205,857.00	0.19
177	603685	晨丰科技	13,400	204,886.00	0.19
178	300211	亿通科技	20,000	202,200.00	0.18
179	688010	福光股份	8,400	202,104.00	0.18
180	300391	长药控股	26,100	202,014.00	0.18
181	002191	劲嘉股份	37,600	201,912.00	0.18
182	300626	华瑞股份	18,500	200,725.00	0.18
183	301068	大地海洋	6,600	200,640.00	0.18
184	003030	祖名股份	9,200	198,720.00	0.18
185	603351	威尔药业	7,500	197,775.00	0.18
186	601218	吉鑫科技	49,400	197,600.00	0.18
187	002452	长高电新	27,800	197,380.00	0.18
188	002356	赫美集团	39,300	196,893.00	0.18
189	688325	赛微微电	5,000	195,950.00	0.18
190	300453	三鑫医疗	25,600	195,328.00	0.18
191	688687	凯因科技	5,600	195,216.00	0.18
192	600522	中天科技	15,500	193,595.00	0.18
193	300377	赢时胜	24,800	192,448.00	0.17
194	002849	威星智能	10,300	192,198.00	0.17
195	688580	伟思医疗	3,000	191,790.00	0.17
196	000823	超声电子	19,900	190,443.00	0.17
197	002899	英派斯	11,500	190,325.00	0.17
198	300536	农尚环境	8,400	189,840.00	0.17
199	300175	朗源股份	31,600	189,600.00	0.17
200	002842	翔鹭钨业	21,600	188,352.00	0.17
201	300592	华凯易佰	7,600	188,252.00	0.17

202	688489	三未信安	4,000	188,080.00	0.17
203	300280	紫天科技	4,400	188,012.00	0.17
204	002483	润邦股份	35,900	187,398.00	0.17
205	300225	金力泰	19,100	186,798.00	0.17
206	000668	荣丰控股	14,700	186,690.00	0.17
207	300522	世名科技	13,800	186,300.00	0.17
208	300550	和仁科技	12,400	185,876.00	0.17
209	603012	创力集团	31,200	184,392.00	0.17
210	000589	贵州轮胎	30,100	184,212.00	0.17
211	000759	中百集团	42,100	183,977.00	0.17
212	000020	深华发 A	14,200	183,890.00	0.17
213	300621	维业股份	16,000	183,840.00	0.17
214	002589	瑞康医药	56,100	183,447.00	0.17
215	603569	长久物流	14,800	183,372.00	0.17
216	300928	华安鑫创	3,600	181,584.00	0.16
217	002144	宏达高科	15,300	177,786.00	0.16
218	000554	泰山石油	30,300	174,831.00	0.16
219	300049	福瑞股份	4,000	174,360.00	0.16
220	000965	天保基建	55,100	172,463.00	0.16
221	688319	欧林生物	10,800	170,640.00	0.16
222	002743	富煌钢构	28,500	170,430.00	0.15
223	688115	思林杰	4,900	169,883.00	0.15
224	605177	东亚药业	6,400	169,472.00	0.15
225	688195	腾景科技	4,700	169,153.00	0.15
226	002421	达实智能	52,500	169,050.00	0.15
227	000686	东北证券	23,700	168,270.00	0.15
228	002479	富春环保	35,100	167,427.00	0.15
229	000809	铁岭新城	54,800	166,592.00	0.15
230	600794	保税科技	40,800	166,464.00	0.15
231	002390	信邦制药	37,400	166,056.00	0.15
232	688096	京源环保	17,700	165,849.00	0.15
233	603551	奥普家居	15,600	165,204.00	0.15
234	688579	山大地纬	13,000	165,100.00	0.15
235	300294	博雅生物	4,900	165,032.00	0.15
236	300695	兆丰股份	3,100	164,176.00	0.15
237	002746	仙坛股份	23,200	163,328.00	0.15
238	600252	中恒集团	65,000	163,150.00	0.15
239	301178	天亿马	4,900	158,907.00	0.14
240	600785	新华百货	10,700	158,360.00	0.14
241	603655	朗博科技	7,600	158,232.00	0.14
242	600202	哈空调	25,000	156,000.00	0.14
243	600080	金花股份	20,800	154,960.00	0.14
244	301149	隆华新材	12,500	154,625.00	0.14

245	300315	掌趣科技	29,700	152,955.00	0.14
246	000886	海南高速	37,300	152,930.00	0.14
247	300717	华信新材	9,100	152,789.00	0.14
248	688160	步科股份	2,600	151,268.00	0.14
249	601827	三峰环境	20,100	150,951.00	0.14
250	688360	德马科技	7,400	148,518.00	0.13
251	603321	梅轮电梯	17,300	147,742.00	0.13
252	600425	青松建化	37,100	146,545.00	0.13
253	300617	安靠智电	4,800	145,728.00	0.13
254	688613	奥精医疗	6,500	144,690.00	0.13
255	600368	五洲交通	36,600	144,570.00	0.13
256	002665	首航高科	56,700	144,018.00	0.13
257	688299	长阳科技	10,300	143,685.00	0.13
258	688292	浩瀚深度	5,200	143,104.00	0.13
259	000504	南华生物	12,300	142,680.00	0.13
260	301167	建研设计	8,400	142,128.00	0.13
261	601727	上海电气	33,800	140,946.00	0.13
262	301296	新巨丰	13,600	140,080.00	0.13
263	002674	兴业科技	11,500	139,955.00	0.13
264	002436	兴森科技	9,500	139,935.00	0.13
265	603920	世运电路	7,600	138,928.00	0.13
266	000731	四川美丰	18,700	138,380.00	0.13
267	001218	丽臣实业	6,400	138,304.00	0.13
268	300230	永利股份	34,300	138,229.00	0.13
269	601222	林洋能源	21,600	138,024.00	0.13
270	603167	渤海轮渡	15,400	136,752.00	0.12
271	300056	中创环保	15,800	136,196.00	0.12
272	600279	重庆港	30,600	136,170.00	0.12
273	300564	筑博设计	10,100	135,946.00	0.12
274	688722	同益中	8,800	134,640.00	0.12
275	601333	广深铁路	51,700	133,903.00	0.12
276	300843	胜蓝股份	5,800	133,284.00	0.12
277	600558	大西洋	32,700	133,089.00	0.12
278	001207	联科科技	7,800	132,990.00	0.12
279	301331	恩威医药	3,200	132,832.00	0.12
280	002318	久立特材	6,600	131,208.00	0.12
281	688228	开普云	2,000	130,860.00	0.12
282	688488	艾迪药业	10,400	130,104.00	0.12
283	003012	东鹏控股	15,400	127,050.00	0.12
284	688066	航天宏图	3,000	126,720.00	0.12
285	300720	海川智能	9,100	126,581.00	0.11
286	600301	华锡有色	10,000	125,800.00	0.11
287	600727	鲁北化工	18,900	124,362.00	0.11

288	002628	成都路桥	37,200	122,760.00	0.11
289	002015	协鑫能科	9,900	122,562.00	0.11
290	300973	立高食品	2,500	121,375.00	0.11
291	601518	吉林高速	47,100	120,105.00	0.11
292	300745	欣锐科技	4,400	119,548.00	0.11
293	002851	麦格米特	4,800	118,080.00	0.11
294	301033	迈普医学	2,700	117,558.00	0.11
295	605066	天正电气	12,800	117,504.00	0.11
296	688269	凯立新材	3,100	114,731.00	0.10
297	600711	盛屯矿业	26,400	114,576.00	0.10
298	300865	大宏立	5,100	114,495.00	0.10
299	688273	麦澜德	3,400	113,254.00	0.10
300	300193	佳士科技	14,400	111,888.00	0.10
301	002540	亚太科技	16,900	111,709.00	0.10
302	000404	长虹华意	18,800	110,732.00	0.10
303	603235	天新药业	4,600	110,584.00	0.10
304	300477	合纵科技	29,000	108,750.00	0.10
305	300411	金盾股份	15,400	107,646.00	0.10
306	002130	沃尔核材	14,200	107,210.00	0.10
307	000902	新洋丰	9,300	105,927.00	0.10
308	000612	焦作万方	18,400	105,800.00	0.10
309	000601	韶能股份	24,700	105,716.00	0.10
310	605166	聚合顺	10,600	105,152.00	0.10
311	000528	柳 工	15,600	105,144.00	0.10
312	002091	江苏国泰	13,300	104,139.00	0.09
313	300020	银江技术	12,500	103,750.00	0.09
314	601566	九牧王	10,400	103,688.00	0.09
315	000685	中山公用	14,100	103,071.00	0.09
316	300091	金通灵	37,700	100,659.00	0.09
317	600097	开创国际	9,400	100,486.00	0.09
318	301159	三维天地	2,200	100,386.00	0.09
319	300364	中文在线	3,900	100,347.00	0.09
320	301093	华兰股份	3,100	100,130.00	0.09
321	600248	陕建股份	24,800	99,696.00	0.09
322	002533	金杯电工	12,200	98,576.00	0.09
323	300081	恒信东方	8,500	98,175.00	0.09
324	688152	麒麟信安	1,400	98,098.00	0.09
325	603579	荣泰健康	4,700	97,901.00	0.09
326	000950	重药控股	19,600	97,412.00	0.09
327	601801	皖新传媒	14,000	97,300.00	0.09
328	002787	华源控股	10,600	97,202.00	0.09
329	688181	八亿时空	3,600	97,200.00	0.09
330	688600	皖仪科技	4,800	96,960.00	0.09

331	301135	瑞德智能	3,900	96,798.00	0.09
332	002651	利君股份	13,900	96,188.00	0.09
333	300668	杰恩设计	3,900	95,940.00	0.09
334	002544	普天科技	4,700	95,504.00	0.09
335	002774	快意电梯	11,500	95,450.00	0.09
336	000807	云铝股份	7,800	95,316.00	0.09
337	300419	浩丰科技	16,100	94,990.00	0.09
338	600237	铜峰电子	12,200	94,428.00	0.09
339	688048	长光华芯	1,500	94,005.00	0.09
340	300452	山河药辅	6,600	93,984.00	0.09
341	002316	亚联发展	18,000	93,780.00	0.09
342	688189	南新制药	9,900	93,357.00	0.08
343	000791	甘肃能源	16,700	93,019.00	0.08
344	002998	优彩资源	11,700	93,015.00	0.08
345	601002	晋亿实业	19,200	92,928.00	0.08
346	688255	凯尔达	3,800	92,910.00	0.08
347	600235	民丰特纸	15,100	92,714.00	0.08
348	603817	海峡环保	14,500	92,510.00	0.08
349	301086	鸿富瀚	2,000	92,440.00	0.08
350	002446	盛路通信	11,100	92,130.00	0.08
351	301058	中粮科工	8,400	91,812.00	0.08
352	300074	华平股份	19,800	91,674.00	0.08
353	002498	汉缆股份	22,900	91,600.00	0.08
354	600076	康欣新材	34,400	91,160.00	0.08
355	301065	本立科技	4,000	91,000.00	0.08
356	688350	富淼科技	5,500	90,915.00	0.08
357	600082	海泰发展	26,300	90,735.00	0.08
358	603365	水星家纺	6,300	90,594.00	0.08
359	600758	辽宁能源	25,000	90,500.00	0.08
360	300851	交大思诺	2,900	90,393.00	0.08
361	601113	华鼎股份	26,100	89,523.00	0.08
362	003006	百亚股份	5,900	89,444.00	0.08
363	688498	源杰科技	600	89,388.00	0.08
364	688175	高凌信息	3,200	89,376.00	0.08
365	600728	佳都科技	15,600	89,232.00	0.08
366	300702	天宇股份	4,100	89,011.00	0.08
367	002884	凌霄泵业	5,100	88,536.00	0.08
368	600033	福建高速	28,400	88,040.00	0.08
369	002775	文科股份	21,900	87,600.00	0.08
370	600225	卓朗科技	22,800	86,640.00	0.08
371	000928	中钢国际	14,700	85,701.00	0.08
372	002453	华软科技	7,500	84,750.00	0.08
373	300743	天地数码	6,100	84,668.00	0.08

374	601929	吉视传媒	45,800	83,356.00	0.08
375	002434	万里扬	11,100	82,695.00	0.08
376	688571	杭华股份	11,000	82,280.00	0.07
377	000407	胜利股份	22,700	82,174.00	0.07
378	300469	信息发展	5,500	80,960.00	0.07
379	600251	冠农股份	9,200	79,948.00	0.07
380	688287	观典防务	8,100	79,947.00	0.07
381	002745	木林森	9,200	79,672.00	0.07
382	000090	天健集团	17,000	78,200.00	0.07
383	600098	广州发展	14,400	77,328.00	0.07
384	000905	厦门港务	10,700	76,719.00	0.07
385	002283	天润工业	13,000	76,050.00	0.07
386	002003	伟星股份	7,000	75,950.00	0.07
387	600483	福能股份	9,100	75,257.00	0.07
388	300645	正元智慧	4,100	74,579.00	0.07
389	002815	崇达技术	7,700	73,766.00	0.07
390	300696	爱乐达	4,100	71,381.00	0.06
391	603507	振江股份	2,700	69,957.00	0.06
392	600084	中信尼雅	8,900	69,954.00	0.06
393	601018	宁波港	19,500	69,420.00	0.06
394	300275	梅安森	6,000	69,180.00	0.06
395	600020	中原高速	18,400	67,712.00	0.06
396	002255	海陆重工	12,100	64,009.00	0.06
397	603602	纵横通信	4,300	63,382.00	0.06
398	002215	诺普信	7,300	60,298.00	0.05
399	603787	新日股份	4,800	60,048.00	0.05
400	688416	恒烁股份	1,000	58,590.00	0.05
401	601718	际华集团	20,600	58,504.00	0.05
402	603337	杰克股份	2,700	58,320.00	0.05
403	002826	易明医药	4,900	58,163.00	0.05
404	000655	金岭矿业	8,000	57,360.00	0.05
405	002085	万丰奥威	11,500	56,810.00	0.05
406	000702	正虹科技	9,000	56,430.00	0.05
407	601366	利群股份	10,100	55,146.00	0.05
408	605123	派克新材	600	54,720.00	0.05
409	601001	晋控煤业	4,200	51,786.00	0.05
410	300838	浙江力诺	2,900	47,444.00	0.04
411	300543	朗科智能	4,200	45,864.00	0.04
412	688389	普门科技	2,000	45,020.00	0.04
413	605599	菜百股份	3,000	44,670.00	0.04
414	002681	奋达科技	9,000	44,550.00	0.04
415	600717	天津港	10,600	43,566.00	0.04
416	600645	中源协和	2,000	40,540.00	0.04

417	601399	国机重装	13,900	39,337.00	0.04
418	600420	国药现代	3,900	38,181.00	0.03
419	688159	有方科技	1,000	37,650.00	0.03
420	300908	仲景食品	900	37,143.00	0.03
421	300578	会畅通讯	2,000	35,720.00	0.03
422	603377	东方时尚	7,700	32,417.00	0.03
423	300281	金明精机	5,300	31,747.00	0.03
424	002264	新华都	5,200	28,652.00	0.03
425	300868	杰美特	1,300	28,236.00	0.03
426	300321	同大股份	1,300	25,155.00	0.02
427	603360	百傲化学	2,200	23,254.00	0.02
428	301098	金埔园林	1,800	21,258.00	0.02
429	600051	宁波联合	2,900	20,938.00	0.02
430	300991	创益通	1,200	20,856.00	0.02
431	300407	凯发电气	1,800	16,992.00	0.02
432	300875	捷强装备	500	14,595.00	0.01
433	002652	扬子新材	4,000	12,760.00	0.01
434	000949	新乡化纤	3,200	10,336.00	0.01
435	300927	江天化学	500	8,425.00	0.01
436	300234	开尔新材	1,400	7,294.00	0.01
437	300789	唐源电气	300	6,762.00	0.01
438	600768	宁波富邦	500	5,925.00	0.01
439	600616	金枫酒业	800	5,008.00	0.00
440	300153	科泰电源	500	3,990.00	0.00
441	002868	绿康生化	100	2,126.00	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	688319	欧林生物	3,140,776.97	3.56
2	002463	沪电股份	3,125,692.00	3.55
3	002174	游族网络	2,929,369.00	3.32
4	300394	天孚通信	2,823,540.00	3.20
5	300051	璘升科技	2,816,841.00	3.20
6	600331	宏达股份	2,751,046.00	3.12
7	688262	国芯科技	2,734,115.06	3.10
8	688348	昱能科技	2,728,357.94	3.10
9	300280	紫天科技	2,550,979.00	2.89
10	002371	北方华创	2,519,446.00	2.86
11	002198	嘉应制药	2,507,033.00	2.84
12	300002	神州泰岳	2,499,838.00	2.84
13	688579	山大地纬	2,316,527.39	2.63

14	688787	海天瑞声	2,288,593.42	2.60
15	002517	恺英网络	2,259,567.00	2.56
16	300494	盛天网络	2,228,487.00	2.53
17	688039	当虹科技	2,186,460.77	2.48
18	688108	赛诺医疗	2,164,588.09	2.46
19	300308	中际旭创	2,150,388.00	2.44
20	688365	光云科技	2,138,313.61	2.43
21	300059	东方财富	2,096,973.00	2.38
22	601138	工业富联	2,095,595.00	2.38
23	688256	寒武纪	2,079,276.25	2.36
24	603676	卫信康	2,075,383.00	2.35
25	300229	拓尔思	2,015,967.69	2.29
26	000988	华工科技	2,013,989.00	2.28
27	688111	金山办公	2,004,472.86	2.27
28	301030	仕净科技	1,996,992.00	2.27
29	688390	固德威	1,994,138.94	2.26
30	600225	卓朗科技	1,978,026.00	2.24
31	600129	太极集团	1,970,903.00	2.24
32	002292	奥飞娱乐	1,963,167.00	2.23
33	002027	分众传媒	1,959,789.00	2.22
34	300476	胜宏科技	1,952,948.00	2.22
35	603000	人民网	1,925,787.00	2.18
36	000100	TCL 科技	1,922,090.00	2.18
37	603605	珀莱雅	1,910,304.82	2.17
38	300254	仟源医药	1,907,889.00	2.16
39	300192	科德教育	1,906,615.00	2.16
40	601899	紫金矿业	1,903,383.00	2.16
41	688072	拓荆科技	1,900,138.18	2.16
42	002230	科大讯飞	1,895,765.00	2.15
43	300624	万兴科技	1,891,495.00	2.15
44	300058	蓝色光标	1,889,965.00	2.14
45	688981	中芯国际	1,877,003.75	2.13
46	601333	广深铁路	1,869,363.00	2.12
47	000063	中兴通讯	1,859,972.00	2.11
48	301052	果麦文化	1,855,282.00	2.10
49	000818	航锦科技	1,855,249.00	2.10
50	688569	铁科轨道	1,849,670.21	2.10
51	301070	开勒股份	1,841,229.55	2.09
52	300426	唐德影视	1,836,828.00	2.08
53	300551	古鳌科技	1,827,428.54	2.07
54	600052	东望时代	1,826,532.00	2.07
55	300502	新易盛	1,810,357.00	2.05
56	601958	金钼股份	1,807,217.00	2.05

57	300779	惠城环保	1,789,546.00	2.03
58	688327	云从科技	1,788,713.07	2.03
59	688078	龙软科技	1,785,819.03	2.03
60	688711	宏微科技	1,784,622.69	2.02
61	688566	吉贝尔	1,784,338.39	2.02
62	002600	领益智造	1,779,401.00	2.02
63	001270	铖昌科技	1,774,011.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	3,396,348.89	3.85
2	002463	沪电股份	3,225,886.00	3.66
3	300059	东方财富	3,058,039.20	3.47
4	688319	欧林生物	3,024,582.18	3.43
5	002198	嘉应制药	2,925,241.00	3.32
6	300051	璩升科技	2,910,137.00	3.30
7	002174	游族网络	2,873,293.00	3.26
8	300394	天孚通信	2,847,725.00	3.23
9	688348	昱能科技	2,774,012.92	3.15
10	600331	宏达股份	2,757,479.98	3.13
11	688262	国芯科技	2,607,915.58	2.96
12	300765	新诺威	2,553,988.53	2.90
13	688787	海天瑞声	2,439,892.43	2.77
14	601318	中国平安	2,421,402.00	2.75
15	300280	紫天科技	2,419,475.00	2.74
16	002517	恺英网络	2,400,346.00	2.72
17	002446	盛路通信	2,350,288.01	2.67
18	300002	神州泰岳	2,288,570.00	2.60
19	688123	聚辰股份	2,266,930.11	2.57
20	601138	工业富联	2,255,833.00	2.56
21	601162	天风证券	2,247,556.00	2.55
22	300494	盛天网络	2,243,215.00	2.54
23	002832	比音勒芬	2,236,967.70	2.54
24	300229	拓尔思	2,208,359.00	2.51
25	002368	太极股份	2,186,263.00	2.48
26	688256	寒武纪	2,175,117.30	2.47
27	688579	山大地纬	2,139,149.45	2.43
28	688039	当虹科技	2,131,784.92	2.42
29	301030	仕净科技	2,114,984.00	2.40
30	300308	中际旭创	2,100,055.00	2.38
31	605020	永和股份	2,098,882.00	2.38

32	300763	锦浪科技	2,096,603.00	2.38
33	688111	金山办公	2,089,275.23	2.37
34	688390	固德威	2,087,178.27	2.37
35	002738	中矿资源	2,086,901.00	2.37
36	000988	华工科技	2,066,406.00	2.34
37	300750	宁德时代	2,051,855.20	2.33
38	300476	胜宏科技	2,044,071.00	2.32
39	688981	中芯国际	2,043,608.22	2.32
40	002230	科大讯飞	2,029,015.00	2.30
41	688365	光云科技	2,019,980.78	2.29
42	002179	中航光电	2,010,940.00	2.28
43	300058	蓝色光标	2,008,090.00	2.28
44	002466	天齐锂业	2,006,291.00	2.28
45	600129	太极集团	1,996,118.00	2.26
46	002847	盐津铺子	1,994,747.00	2.26
47	300624	万兴科技	1,979,959.00	2.25
48	601899	紫金矿业	1,951,812.00	2.21
49	002027	分众传媒	1,938,395.00	2.20
50	002292	奥飞娱乐	1,917,402.00	2.18
51	600780	通宝能源	1,911,059.00	2.17
52	300192	科德教育	1,907,475.00	2.16
53	300426	唐德影视	1,899,916.80	2.16
54	002858	力盛体育	1,893,046.00	2.15
55	600225	卓朗科技	1,886,280.00	2.14
56	688569	铁科轨道	1,883,466.97	2.14
57	688072	拓荆科技	1,877,919.56	2.13
58	688327	云从科技	1,870,356.92	2.12
59	000063	中兴通讯	1,851,895.34	2.10
60	688639	华恒生物	1,843,998.33	2.09
61	301052	果麦文化	1,841,598.00	2.09
62	600052	东望时代	1,837,722.00	2.08
63	600521	华海药业	1,834,652.00	2.08
64	603000	人民网	1,830,940.00	2.08
65	002422	科伦药业	1,819,124.00	2.06
66	000100	TCL 科技	1,815,065.90	2.06
67	688566	吉贝尔	1,807,162.52	2.05
68	688108	赛诺医疗	1,803,661.97	2.05
69	603283	赛腾股份	1,800,156.00	2.04
70	300502	新易盛	1,797,939.00	2.04
71	601333	广深铁路	1,791,582.00	2.03
72	600900	长江电力	1,786,035.00	2.03
73	300551	古鳌科技	1,778,285.00	2.02
74	688158	优刻得	1,775,468.12	2.01

75	300896	爱美客	1,770,222.00	2.01
76	601688	华泰证券	1,766,400.00	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	1,115,787,689.91
卖出股票收入（成交）总额	1,096,385,864.99

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

注：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

杭州华光焊接新材料股份有限公司

2023年7月14日因公司2022年度业绩快报相关信息披露不准确、更正不及时，被中国证监会浙江监管局警示。

金冠电器股份有限公司

2023 年 12 月 26 日因公司未及时披露公司重大事件，重大事项未履行审议程序，被中国证监会河南监管局警示。

上海仁度生物科技股份有限公司

2023 年 10 月 9 日因公司未按期缴纳税款，被国家税务总局上海市浦东新区税务局第二税务所要求责令改正。

湖南艾布鲁环保科技股份有限公司

2023 年 1 月 3 日因公司违法税收管理规定，被国家税务总局益阳市资阳区税务局要求责令整改。

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	5,664,421.19
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,710,859.26
6	其他应收款	194.44
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,375,474.89

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	940	29,037.59	3,415,546.57	12.51	23,879,788.06	87.49
德邦量化优选股票 C	1,089	57,336.41	32,871,260.12	52.65	29,568,088.10	47.35
合计	2,029	44,226.06	36,286,806.69	40.44	53,447,876.16	59.56

9.2 期末上市基金前十名持有人

9.3 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	79,096.43	0.2898
	德邦量化优选股票 C	542,438.65	0.8687
	合计	621,535.08	0.6926

9.4 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	0~10
	德邦量化优选股票 C	50~100
	合计	50~100

9.5 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	25,563,278.62	45,589,090.69
本报告期基金总申 购份额	31,592,265.27	60,379,631.62
减：本报告期基金 总赎回份额	29,860,209.26	43,529,374.09
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金 份额总额	27,295,334.63	62,439,348.22

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 2023 年 2 月 18 日公告，莫秋琴女士担任公司副总经理。

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2023 年 4 月 1 日公告，吴晨先生离任公司联席总经理。

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2023 年 7 月 8 日公告，张騫先生代任公司督察长，张秀玉先生不再担任公司督察长。

本基金管理人德邦基金管理有限公司于 2023 年 10 月 19 日公告，徐晓红女士担任公司督察长，张騫先生不再代任公司督察长。

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 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

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华林证券	2	1,947,759,875.99	88.05	1,426,577.86	94.22	-
兴业证券	2	264,413,678.91	11.95	87,590.77	5.78	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	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要；
- (6) 研究实力较强，能根据需求提供质量较高的研究报告，以及相应的信息咨询服务；
- (7) 收取的佣金费率合理。

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

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

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

2、本基金自 2023 年 2 月 20 日起转换为券商结算模式，此前使用的基金交易单元自转换为券商结算模式后均不再使用，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定；基金管理人与证券经纪商不存在关联关系；基金管理人根据监管规定选择具备证券经纪业务资格的证券公司，并签订证券经纪服务协议。

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(%)
华林证券	688,930.80	100.00	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
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	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

	优惠活动的公告		
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	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）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分基金增加国金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 3 日
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优选股票型证券投资基金（LOF）证券交易模式转换有关事项的公告	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 16 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	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）托管协议	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 22 日
10	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）证券交易模式转换完成的公告	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 22 日
11	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（德邦量化优选股票 A 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 2 月 22 日
12	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）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 2 月 22 日
13	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（德邦量化优选股票 C 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 2 月 22 日
14	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
15	德邦基金管理有限公司关于调整德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）最低申购（含定期定额投资）金额、追加申购最低金额、赎	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 10 日

	回份额及最低持有份额业务规则的公告		
16	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 3 月 24 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 30 日
18	德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)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
19	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
20	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
21	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
22	德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)2023 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	2023 年 4 月 20 日
23	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
24	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
25	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
26	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 7 月 8 日
27	德邦量化优选股票型证券投资基金(LOF)2023 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	2023 年 7 月 20 日
28	德邦基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 12 日

29	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）2023 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	2023 年 8 月 30 日
30	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2023 年第 2 号）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 8 月 31 日
31	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（德邦量化优选股票 A 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 8 月 31 日
32	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（德邦量化优选股票 C 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 8 月 31 日
33	德邦基金管理有限公司关于暂停尚智逢源（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 9 月 19 日
34	德邦基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）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	2023 年 9 月 27 日
35	关于中州期货有限公司因系统改造暂停办理德邦基金管理有限公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 10 月 14 日
36	德邦基金管理有限公司关于终止尚智逢源（北京）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	2023 年 10 月 18 日
37	德邦基金管理有限公司基金行业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 10 月 19 日
38	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）2023 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	2023 年 10 月 24 日
39	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	2023 年 11 月 20 日
40	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书（2023 年第 3 号）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2023 年 11 月 21 日
41	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（德邦量化优选股票 C 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 11 月 21 日
42	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）（德邦量化优选股票 A 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 11 月 21 日
43	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	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2023 年 12 月 27 日

	证明文件的公告	站	
44	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年底及 2024 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	2023 年 12 月 28 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	20230101-20231231	19,266,506.56	16,650,016.65	-	35,916,523.21	40.0300

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、转换入份额；赎回含转换出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2024 年 2 月 9 日发布《德邦基金管理有限公司关于变更股权结构的公告》，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

上海市杨浦区荆州路 198 号万硕大厦 A 栋 25 楼。

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

2024 年 3 月 30 日