

德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式  
证券投资基金  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：德邦基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 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 | 12        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 41        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 52        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 57        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 57        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 57        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 57        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 58        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 58        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 58        |
| 7.12 市场中性策略执行情况 .....                       | 58        |
| 7.13 投资组合报告附注 .....                         | 58        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>61</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 61        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 61        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 62        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 62        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>62</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>63</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 63        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 63        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 63        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 63        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 63        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 63        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 63        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 65        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>67</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 67        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 67        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>68</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 68        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 68        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 68        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                          |                 |
|-----------------|--------------------------|-----------------|
| 基金名称            | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 |                 |
| 基金简称            | 德邦量化对冲混合                 |                 |
| 基金主代码           | 008838                   |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                   |                 |
| 基金合同生效日         | 2020 年 4 月 29 日          |                 |
| 基金管理人           | 德邦基金管理有限公司               |                 |
| 基金托管人           | 交通银行股份有限公司               |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 39,269,803.35 份          |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                      |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 德邦量化对冲混合 A               | 德邦量化对冲混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 008838                   | 008839          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,469,699.53 份          | 22,800,103.82 份 |

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人        | 基金托管人      |
|---------|------|--------------|------------|
| 名称      |      | 德邦基金管理有限公司   | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 徐晓红          | 方圆         |
|         | 联系电话 | 021-26010852 | 95559      |

|        |                                  |                             |
|--------|----------------------------------|-----------------------------|
| 电子邮箱   | service@dbfund.com.cn            | fangy_20@bankcomm.com       |
| 客户服务电话 | 4008217788                       | 95559                       |
| 传真     | 021-26010808                     | 021-62701216                |
| 注册地址   | 上海市虹口区东大名路 501 号<br>503B 单元      | 中国（上海）自由贸易试验区银<br>城中路 188 号 |
| 办公地址   | 上海市杨浦区荆州路 198 号万硕<br>大厦 A 栋 25 楼 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18<br>号        |
| 邮政编码   | 200082                           | 200336                      |
| 法定代表人  | 左畅                               | 任德奇                         |

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                             |
|--------|------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 德邦基金管理有限公司 | 上海市杨浦区荆州路 198 号万<br>硕大厦 A 栋 25 楼 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据<br>和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |               |
|-------------------|-------------------------------------|---------------|
|                   | 德邦量化对冲混合 A                          | 德邦量化对冲混合 C    |
| 本期已实现收益           | 41,131.89                           | 94,498.98     |
| 本期利润              | -29,622.15                          | -274,742.03   |
| 加权平均基金份<br>额本期利润  | -0.0018                             | -0.0112       |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | -0.19%                              | -1.23%        |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | -0.25%                              | -0.38%        |
| 3.1.2 期末数据<br>和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |               |
|                   | 德邦量化对冲混合 A                          | 德邦量化对冲混合 C    |
| 期末可供分配利<br>润      | -2,349,617.66                       | -3,470,693.19 |

|              |                  |               |
|--------------|------------------|---------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1427          | -0.1522       |
| 期末基金资产净值     | 15,017,781.63    | 20,566,322.42 |
| 期末基金份额净值     | 0.9118           | 0.9020        |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024年6月30日) |               |
| 基金份额累计净值增长率  | -8.82%           | -9.80%        |

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦量化对冲混合 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | -0.40%   | 0.35%       | 0.12%      | 0.00%         | -0.52%  | 0.35% |
| 过去三个月      | -0.77%   | 0.37%       | 0.37%      | 0.00%         | -1.14%  | 0.37% |
| 过去六个月      | -0.25%   | 0.47%       | 0.75%      | 0.01%         | -1.00%  | 0.46% |
| 过去一年       | 0.33%    | 0.35%       | 1.52%      | 0.00%         | -1.19%  | 0.35% |
| 过去三年       | -9.33%   | 0.37%       | 4.61%      | 0.00%         | -13.94% | 0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.82%   | 0.34%       | 6.46%      | 0.00%         | -15.28% | 0.34% |

德邦量化对冲混合 C

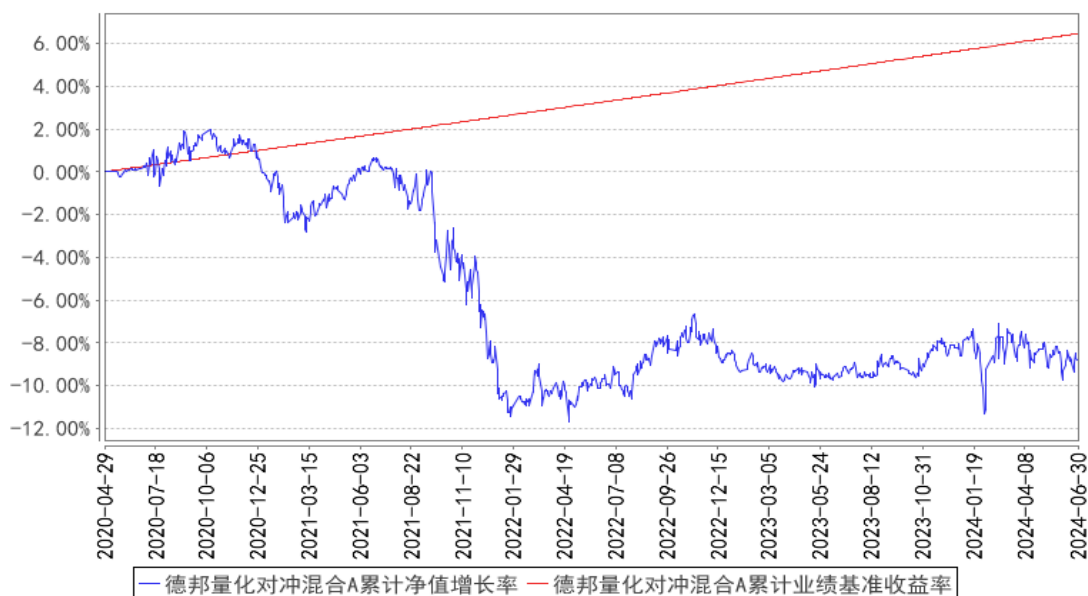
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -0.42%   | 0.35%       | 0.12%      | 0.00%         | -0.54% | 0.35% |

|            |         |       |       |       |         |       |
|------------|---------|-------|-------|-------|---------|-------|
| 过去三个月      | -0.84%  | 0.37% | 0.37% | 0.00% | -1.21%  | 0.37% |
| 过去六个月      | -0.38%  | 0.47% | 0.75% | 0.01% | -1.13%  | 0.46% |
| 过去一年       | 0.08%   | 0.35% | 1.52% | 0.00% | -1.44%  | 0.35% |
| 过去三年       | -10.03% | 0.37% | 4.61% | 0.00% | -14.64% | 0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | -9.80%  | 0.34% | 6.46% | 0.00% | -16.26% | 0.34% |

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

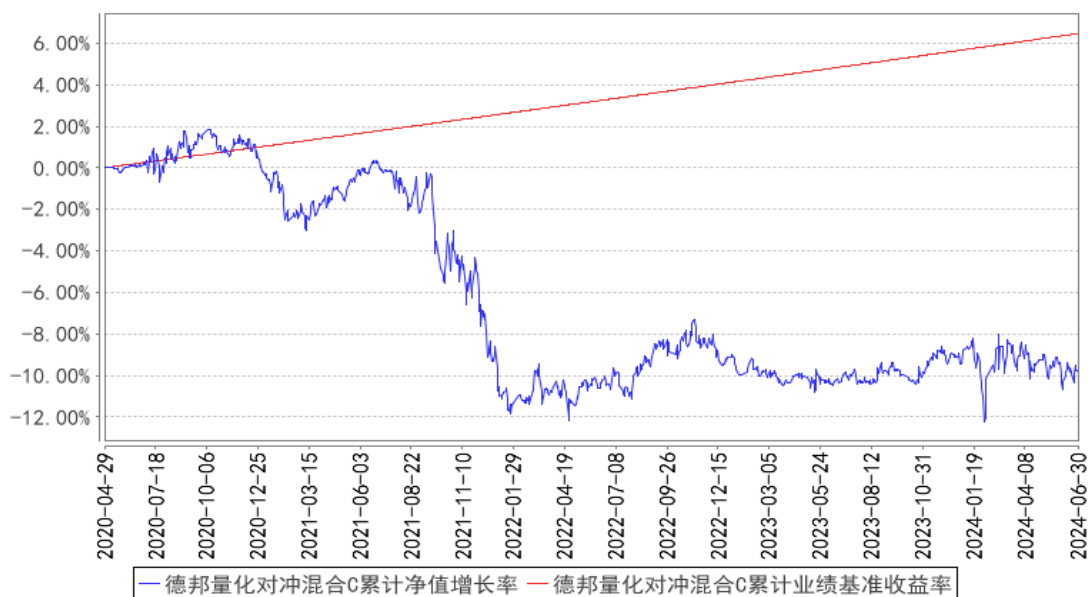
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

德邦量化对冲混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





德邦量化对冲混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2020 年 04 月 29 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2020 年 04 月 29 日至 2024 年 06 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

德邦基金管理有限公司经中国证监会（证监许可[2012]249号）批准，于 2012 年 3 月 27 日正式成立。股东为德邦证券股份有限公司、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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理三十二只开放式基金：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦民裕进取量化精选灵活配置混合型证券投资基金、德邦乐享生活混合型证券投资基金、德邦新添利债券型证券投资基金、德邦锐兴债券型证券投资基金、德邦景颐债券型证券投资基金、德邦锐乾债券型证券投资基金、德邦德利货币市场基金、德邦如意货币市场基金、德邦锐泓债券型证券投资基金、德邦短债债券型证券投资基金、德邦德瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、德

邦锐恒 39 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、德邦大消费混合型证券投资基金、德邦锐泽 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、德邦锐升债券型证券投资基金。

#### 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 | -    | 13 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。 |

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股

票、债券)的收益率差异进行了分析,并对连续两个季度期间内、不同时间窗口下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析,未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况,且未发现其他可能导致不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

2024 年上半年中国 A 股市场整体呈现分化态势,宽基指数与行业主题指数表现各异。上证 50、沪深 300 等宽基指数实现了正收益,而创业板、科创板等成长风格宽基虽有反弹,但整体呈现下跌趋势。市场红利相关策略与跟踪境外市场的产品整体表现较优。

股指期货方面,上半年基差主要受分红预期的影响,整体呈现贴水的趋势。上半年四大股指期货的交易活跃度在近 5 年中处于偏低位置,但中证 1000 股指期货成交量较前两年上升。

在投资管理上,本基金综合使用多因子及人工智能策略,行业市值中性,持股分散,多因子、多策略、多网络、多参数混合。股指期货 CTA 风格轮动策略在大小市值中选择对冲品种。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末德邦量化对冲混合 A 基金份额净值为 0.9118 元,基金份额净值增长率为 -0.25%,同期业绩比较基准收益率为 0.75%;德邦量化对冲混合 C 基金份额净值为 0.9020 元,基金份额净值增长率为 -0.38%,同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年,宏观经济方面,全球经济整体呈现温和复苏的趋势,消费分级趋势可能持续,电商行业竞争激烈,跨境电商市场空间广阔。在国内,经济持续复苏,消费品以旧换新和大规模设备以旧换新将提振消费和制造业投资,资金加速投放将带动基建投资发力,外需持续改善。总体而言,展望下半年,经济和市场有望保持稳定增长的态势,但仍需谨慎应对风险。

1. 宏观经济:市场共识认为 2024 年下半年经济仍存在一定挑战,但分歧在于政策是否发力促使经济企稳。

2. 证券市场:A 股市场先抑后扬,市场估值从低位展开修复,展望下半年有望延续修复行情,投资者预期悲观时期可能已经过去,市场机会大于风险。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格按照本公司制订的《德邦基金管理有限公司基金估值业务管理

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金连续二十个工作日以上出现基金资产净值低于五千万的情形，截至本报告期末，本基金基金资产净值仍低于五千万元。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2024 年上半年度，基金托管人在德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2024 年上半年度，德邦基金管理有限公司在德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2024 年上半年度，由德邦基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 1,517,444.68                   | 2,053,176.83                     |
| 结算备付金         |            | 3,733,484.03                   | 1,881,703.69                     |
| 存出保证金         |            | 2,900,700.22                   | 1,915,808.67                     |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 27,559,088.47                  | 17,193,500.39                    |
| 其中：股票投资       |            | 25,624,526.69                  | 17,158,452.41                    |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 1,934,561.78                   | 35,047.98                        |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                              | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | 285,519.41                     | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 31.83                          | 130.00                           |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 35,996,268.64                  | 23,044,319.58                    |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                |                                  |

|             |          |               |               |
|-------------|----------|---------------|---------------|
| 短期借款        |          | -             | -             |
| 交易性金融负债     |          | -             | -             |
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3  | -             | -             |
| 卖出回购金融资产款   |          | -             | -             |
| 应付清算款       |          | 262,587.03    | -             |
| 应付赎回款       |          | 371.01        | 23,169.37     |
| 应付管理人报酬     |          | 29,618.60     | 19,821.28     |
| 应付托管费       |          | 5,923.71      | 3,964.24      |
| 应付销售服务费     |          | 4,327.14      | 1,506.72      |
| 应付投资顾问费     |          | -             | -             |
| 应交税费        |          | -             | -             |
| 应付利润        |          | -             | -             |
| 递延所得税负债     |          | -             | -             |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 109,337.10    | 94,342.03     |
| 负债合计        |          | 412,164.59    | 142,803.64    |
| <b>净资产：</b> |          |               |               |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 39,269,803.35 | 25,124,949.63 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -             | -             |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | -3,685,699.30 | -2,223,433.69 |
| 净资产合计       |          | 35,584,104.05 | 22,901,515.94 |
| 负债和净资产总计    |          | 35,996,268.64 | 23,044,319.58 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，德邦量化对冲混合 A 基金份额净值 0.9118 元，基金份额总额 16,469,699.53 份；德邦量化对冲混合 C 基金份额净值 0.9020 元，基金份额总额 22,800,103.82 份。德邦量化对冲混合份额总额合计 39,269,803.35 份。

## 6.2 利润表

会计主体：德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目             | 附注号      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b> |          | -6,432.77                                | 209,117.91                                    |
| 1. 利息收入        |          | 21,911.48                                | 60,465.19                                     |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.13 | 17,037.74                                | 60,465.19                                     |
| 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     |          | 4,718.18                                 | -   |
| 其他利息收入         |          | 155.56                                   | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-” |          | 34,484.46                                | 504,039.92                                    |

|                               |            |             |               |
|-------------------------------|------------|-------------|---------------|
| 填列)                           |            |             |               |
| 其中：股票投资收益                     | 6.4.7.14   | -903,978.01 | -3,106,639.14 |
| 基金投资收益                        |            | -           | -             |
| 债券投资收益                        | 6.4.7.15   | 11,732.91   | 9,393.57      |
| 资产支持证券投资<br>收益                | 6.4.7.16   | -           | -             |
| 贵金属投资收益                       | 6.4.7.17   | -           | -             |
| 衍生工具收益                        | 6.4.7.18   | 666,035.96  | 3,191,150.16  |
| 股利收益                          | 6.4.7.19   | 260,693.60  | 410,135.33    |
| 以摊余成本计量的<br>金融资产终止确认产生的<br>收益 |            | -           | -             |
| 其他投资收益                        |            | -           | -             |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)        | 6.4.7.20   | -439,995.05 | -463,192.93   |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)            |            | -           | -             |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)            | 6.4.7.21   | 377,166.34  | 107,805.73    |
| <b>减：二、营业总支出</b>              |            | 297,931.41  | 472,443.66    |
| 1. 管理人报酬                      | 6.4.10.2.1 | 187,033.86  | 315,005.81    |
| 其中：暂估管理人报酬                    |            | -           | -             |
| 2. 托管费                        | 6.4.10.2.2 | 37,406.72   | 63,001.19     |
| 3. 销售服务费                      | 6.4.10.2.3 | 27,512.49   | 54,510.90     |
| 4. 投资顾问费                      |            | -           | -             |
| 5. 利息支出                       |            | -           | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出                 |            | -           | -             |
| 6. 信用减值损失                     | 6.4.7.22   | -           | -             |
| 7. 税金及附加                      |            | 6,908.60    | 11,549.37     |
| 8. 其他费用                       | 6.4.7.23   | 39,069.74   | 28,376.39     |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>    |            | -304,364.18 | -263,325.75   |
| 减：所得税费用                       |            | -           | -             |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>      |            | -304,364.18 | -263,325.75   |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>          |            | -           | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>               |            | -304,364.18 | -263,325.75   |

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日      |        |               |                |
|--|--|--------|---------------|----------------|
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 25,124,949.63                              | -      | -2,223,433.69 | 22,901,515.94  |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -  | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 25,124,949.63                              | -      | -2,223,433.69 | 22,901,515.94  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 14,144,853.72                              | -      | -1,462,265.61 | 12,682,588.11  |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | -304,364.18   | -304,364.18    |
| (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)      | 14,144,853.72                              | -      | -1,157,901.43 | 12,986,952.29  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 64,807,820.88                              | -      | -5,891,306.11 | 58,916,514.77  |
| 2. 基金赎回款                                 | -50,662,967.16                             | -      | 4,733,404.68  | -45,929,562.48 |
| (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                                | 39,269,803.35                              | -      | -3,685,699.30 | 35,584,104.05  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |        |               |                |
|  | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 22,005,105.25                              | -      | -1,899,033.42 | 20,106,071.83  |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -             | -              |



|  |                 |   |                |                 |
|--|-----------------|---|----------------|-----------------|
| 前期差错更正                                   | -               | - | -              | -               |
| 其他                                       | -               | - | -              | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 22,005,105.25   | - | -1,899,033.42  | 20,106,071.83   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 14,703,945.98   | - | -1,564,169.58  | 13,139,776.40   |
| (一)、综合收益总额                               | -               | - | -263,325.75    | -263,325.75     |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 14,703,945.98   | - | -1,300,843.83  | 13,403,102.15   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 238,579,218.59  | - | -24,107,748.21 | 214,471,470.38  |
| 2. 基金赎回款                                 | -223,875,272.61 | - | 22,806,904.38  | -201,068,368.23 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(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                                | 36,709,051.23   | - | -3,463,203.00  | 33,245,848.23   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

张騷

洪双龙

洪双龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证

券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2890 号文《关于准予德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人德邦基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2020 年 4 月 29 日生效。首次设立时募集规模为 191,956,539.03 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为德邦基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股票期权、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

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

注：本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

注：本基金本报告期无重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

注：本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

注：本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

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

#### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

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

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额

计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,517,444.68           |
| 等于：本金          | 1,517,349.02           |
| 加：应计利息         | 95.66                  |
| 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             | 1,517,444.68           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |              |               |               |           |
|-------------------|------------------------|--------------|---------------|---------------|-----------|
|                   | 成本                     | 应计利息         | 公允价值          | 公允价值变动        |           |
| 股票                | 26,669,946.45          | -            | 25,624,526.69 | -1,045,419.76 |           |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -            | -             | -             |           |
| 债券                | 交易所市场                  | 1,907,239.00 | 29,811.78     | 1,934,561.78  | -2,489.00 |
|                   | 银行间市场                  | -            | -             | -             | -         |
|                   | 合计                     | 1,907,239.00 | 29,811.78     | 1,934,561.78  | -2,489.00 |
| 资产支持证券            | -                      | -            | -             | -             |           |

|    |               |           |               |               |
|----|---------------|-----------|---------------|---------------|
| 基金 | -             | -         | -             | -             |
| 其他 | -             | -         | -             | -             |
| 合计 | 28,577,185.45 | 29,811.78 | 27,559,088.47 | -1,047,908.76 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2024年6月30日 |      |    |    |
|-----------|-------------------|------|----|----|
|           | 合同/名义<br>金额       | 公允价值 |    | 备注 |
|           |                   | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具    | -                 | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具    | -                 | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具    | -24,628,380.00    | -    | -  | -  |
| 其中：股指期货投资 | -24,628,380.00    | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具    | -                 | -    | -  | -  |
| 合计        | -24,628,380.00    | -    | -  | -  |

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算备付金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码         | 名称     | 持仓量（买/卖） | 合约市值           | 公允价值变动     |
|------------|--------|----------|----------------|------------|
| IF2407     | IF2407 | -10.00   | -10,311,000.00 | 67,020.00  |
| IF2412     | IF2412 | -3.00    | -3,079,800.00  | 194,040.00 |
| IM2407     | IM2407 | -7.00    | -6,801,200.00  | 238,040.00 |
| IM2409     | IM2409 | -4.00    | -3,824,160.00  | 113,120.00 |
| 合计         |        |          |                | 612,220.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 |        |          |                | 612,220.00 |
| 净额         |        |          |                | -          |

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末不存在按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有以摊余成本计量的债务工具投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

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

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

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

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 74,767.36         |

|          |            |
|----------|------------|
| 其中：交易所市场 | 74,767.36  |
| 银行间市场    | -          |
| 应付利息     | -          |
| 应付信息披露费  | 15,151.20  |
| 应付审计费    | 14,918.54  |
| 应付账户维护费  | 4,500.00   |
| 合计       | 109,337.10 |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 德邦量化对冲混合 A

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |               |
|---------------|----------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额          |
| 上年度末          | 17,699,185.37              | 17,699,185.37 |
| 本期申购          | 172,226.03                 | 172,226.03    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,401,711.87              | -1,401,711.87 |
| 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           | 16,469,699.53              | 16,469,699.53 |

##### 德邦量化对冲混合 C

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 7,425,764.26               | 7,425,764.26   |
| 本期申购          | 64,635,594.85              | 64,635,594.85  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -49,261,255.29             | -49,261,255.29 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                          | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                          | -              |
| 本期申购          | -                          | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                          | -              |
| 本期末           | 22,800,103.82              | 22,800,103.82  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 德邦量化对冲混合 A

| 项目   | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末 | -2,563,856.05 | 1,042,851.69 | -1,521,004.36 |



|                |               |              |               |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 加：会计政策变更       | -             | -            | -             |
| 前期差错更正         | -             | -            | -             |
| 其他             | -             | -            | -             |
| 本期期初           | -2,563,856.05 | 1,042,851.69 | -1,521,004.36 |
| 本期利润           | 41,131.89     | -70,754.04   | -29,622.15    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 173,106.50    | -74,397.89   | 98,708.61     |
| 其中：基金申购款       | -26,217.63    | 12,664.29    | -13,553.34    |
| 基金赎回款          | 199,324.13    | -87,062.18   | 112,261.95    |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | -2,349,617.66 | 897,699.76   | -1,451,917.90 |

## 德邦量化对冲混合 C

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|----------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | -1,137,723.61  | 435,294.28    | -702,429.33   |
| 加：会计政策变更       | -              | -             | -             |
| 前期差错更正         | -              | -             | -             |
| 其他             | -              | -             | -             |
| 本期期初           | -1,137,723.61  | 435,294.28    | -702,429.33   |
| 本期利润           | 94,498.98      | -369,241.01   | -274,742.03   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,427,468.56  | 1,170,858.52  | -1,256,610.04 |
| 其中：基金申购款       | -10,141,248.99 | 4,263,496.22  | -5,877,752.77 |
| 基金赎回款          | 7,713,780.43   | -3,092,637.70 | 4,621,142.73  |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -             |
| 本期末            | -3,470,693.19  | 1,236,911.79  | -2,233,781.40 |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 7,765.77                   |
| 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 | 9,068.07                   |
| 其他        | 203.90                     |
| 合计        | 17,037.74                  |

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -903,978.01                |
| 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               | -903,978.01 |

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 206,733,111.11       |
| 减：卖出股票成本总额 | 207,360,025.78       |
| 减：交易费用     | 277,063.34           |
| 买卖股票差价收入   | -903,978.01          |

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                   |
|------------------------------|----------------------|
|                              | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 7,426.81             |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,306.10             |
| 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                           | 11,732.91            |

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 34,528.39            |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 30,200.00            |
| 减：应计利息总额               | 20.90                |
| 减：交易费用                 | 1.39                 |
| 买卖债券差价收入               | 4,306.10             |

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无债券投资收益申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

| 项目       | 本期                   |
|----------|----------------------|
|          | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股指期货投资收益 | 666,035.96           |

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期                   |
|-------------|----------------------|
|             | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 260,693.60           |

|               |            |
|---------------|------------|
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -          |
| 基金投资产生的股利收益   | -          |
| 合计            | 260,693.60 |

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产             | -997,423.80          |
| 股票投资                   | -990,103.92          |
| 债券投资                   | -7,319.88            |
| 资产支持证券投资               | -                    |
| 基金投资                   | -                    |
| 贵金属投资                  | -                    |
| 其他                     | -                    |
| 2. 衍生工具                | 557,428.75           |
| 权证投资                   | -                    |
| 期货投资                   | 557,428.75           |
| 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                     | -439,995.05          |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 377,126.25           |
| 基金转换费收入 | 40.09                |
| 合计      | 377,166.34           |

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 审计费用    | 14,918.54            |
| 信息披露费   | 15,151.20            |
| 证券出借违约金 | -                    |
| 账户维护费   | 9,000.00             |
| 合计      | 39,069.74            |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系   |
|----------------------|-----------|
| 德邦基金管理有限公司（“德邦基金”）   | 基金管理人     |
| 交通银行股份有限公司（“交通银行”）   | 基金托管人     |
| 德邦证券股份有限公司（“德邦证券”）   | 基金管理人的股东  |
| 德邦创新资本有限责任公司（“德邦创新”） | 基金管理人的子公司 |

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期                   | 上年度可比期间              |
|------------------|----------------------|----------------------|
|                  | 2024年1月1日至2024年6月30日 | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 187,033.86           | 315,005.81           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 43,441.75            | 89,997.86            |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 143,592.11           | 225,007.95           |

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

$$H = E * 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2024年1月1日至2024年6月30日 | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 37,406.72            | 63,001.19            |

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

计算方法如下：

$$H = E * 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                   |            |           |
|----------------|----------------------|------------|-----------|
|                | 2024年1月1日至2024年6月30日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |            |           |
|                | 德邦量化对冲混合 A           | 德邦量化对冲混合 C | 合计        |
| 德邦基金           | -                    | 18,361.05  | 18,361.05 |
| 德邦证券           | -                    | 5,661.54   | 5,661.54  |
| 交通银行           | -                    | 201.68     | 201.68    |

|                |                                 |            |           |
|----------------|---------------------------------|------------|-----------|
| 合计             | -                               | 24,224.27  | 24,224.27 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|                | 德邦量化对冲混合 A                      | 德邦量化对冲混合 C | 合计        |
| 德邦基金           | -                               | 18,251.67  | 18,251.67 |
| 德邦证券           | -                               | 11,970.41  | 11,970.41 |
| 交通银行           | -                               | 6,342.94   | 6,342.94  |
| 合计             | -                               | 36,565.02  | 36,565.02 |

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类基金份额前一日基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                         | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |            |
|----------------------------|----------------------------|------------|
|                            | 德邦量化对冲混合 A                 | 德邦量化对冲混合 C |
| 基金合同生效日（2020年4月29日）持有的基金份额 | -                          | -          |
| 报告期初持有的基金份额                | 10,217,097.08              | -          |

|                            |                                 |            |
|----------------------------|---------------------------------|------------|
| 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                | 10,217,097.08                   | -          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 62.0357%                        | -          |
| 项目                         | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |            |
|                            | 德邦量化对冲混合 A                      | 德邦量化对冲混合 C |
| 基金合同生效日（2020年4月29日）持有的基金份额 | -                               | -          |
| 报告期初持有的基金份额                | 9,999,200.00                    | -          |
| 报告期间申购/买入总份额               | 0.00                            | -          |
| 报告期间因拆分变动份额                | 0.00                            | -          |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额             | 0.00                            | -          |
| 报告期末持有的基金份额                | 9,999,200.00                    | -          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例        | 47.3004%                        | -          |

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

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

##### 德邦量化对冲混合 C

| 关联方名称 | 本期末<br>2024年6月30日 |                      | 上年度末<br>2023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  | 16,474,464.58     | 72.2561              | -                   | -                    |

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|----------|---------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入   | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 交通银行  | 1,517,444.68               | 7,765.77 | 2,055,567.52                    | 12,461.25 |

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



#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未发生其它关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理，对公司建立风险管理体系和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，协助董事会进行风险管理，风险管理委员会负责起草公司风险管理战略，审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。经理层负责落实董事会拟定的风险管理政策，并对风险控制的有效执行承担责任。经理层下设风险控制委员会，协助经理层进行风险控制，风险控制委员会负责组织风险管理体系的建设，确定风险管理原则、目标和方法，审议风险管理制度和流程，指导重大风险事件的处理。督

察长负责监督检查公司风险管理工作的执行情况，评价公司内部风险控制制度的合法性、合规性和有效性，并向董事会报告。监察稽核部门为日常风险管理的执行部门，主要负责对公司经营管理和受托投资风险的预警和事中控制，对有关风险进行分析并向经理层汇报。公司各部门是风险控制措施的执行部门，负责识别和控制业务活动中潜在风险，做好风险的事先防范。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 1,934,561.78           | -                        |
| 合计     | 1,934,561.78           | -                        |

注：未评级部分为国债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | -                      | -                        |
| AAA 以下 | -                      | 35,047.98                |
| 未评级    | -                      | -                        |
| 合计     | -                      | 35,047.98                |

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

**6.4.13.3 流动性风险**

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

**6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析****6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年6月30日   | 1个月以内        | 1-3个月 | 3个月-1年       | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|---------------------|--------------|-------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                  |              |       |              |      |      |               |               |
| 货币资金                | 1,517,444.68 | -     | -            | -    | -    | -             | 1,517,444.68  |
| 结算备付金               | 3,733,484.03 | -     | -            | -    | -    | -             | 3,733,484.03  |
| 存出保证金               | 2,900,700.22 | -     | -            | -    | -    | -             | 2,900,700.22  |
| 交易性金融资产             | -            | -     | 1,934,561.78 | -    | -    | 25,624,526.69 | 27,559,088.47 |
| 应收申购款               | -            | -     | -            | -    | -    | 31.83         | 31.83         |
| 应收清算款               | -            | -     | -            | -    | -    | 285,519.41    | 285,519.41    |
| 资产总计                | 8,151,628.93 | -     | 1,934,561.78 | -    | -    | 25,910,077.93 | 35,996,268.64 |
| 负债                  |              |       |              |      |      |               |               |
| 应付赎回款               | -            | -     | -            | -    | -    | 371.01        | 371.01        |
| 应付管理人报酬             | -            | -     | -            | -    | -    | 29,618.60     | 29,618.60     |
| 应付托管费               | -            | -     | -            | -    | -    | 5,923.71      | 5,923.71      |
| 应付清算款               | -            | -     | -            | -    | -    | 262,587.03    | 262,587.03    |
| 应付销售服务费             | -            | -     | -            | -    | -    | 4,327.14      | 4,327.14      |
| 其他负债                | -            | -     | -            | -    | -    | 109,337.10    | 109,337.10    |
| 负债总计                | -            | -     | -            | -    | -    | 412,164.59    | 412,164.59    |
| 利率敏感度缺口             | 8,151,628.93 | -     | 1,934,561.78 | -    | -    | 25,497,913.34 | 35,584,104.05 |
| 上年度末<br>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                | 2,053,176.83 | -     | -            | -    | -    | -             | 2,053,176.83  |
| 结算备付金               | 1,881,703.69 | -     | -            | -    | -    | -             | 1,881,703.69  |
| 存出保证金               | 1,915,808.67 | -     | -            | -    | -    | -             | 1,915,808.67  |
| 交易性金融资产             | -            | -     | 35,047.98    | -    | -    | 17,158,452.41 | 17,193,500.39 |
| 应收申购款               | -            | -     | -            | -    | -    | 130.00        | 130.00        |
| 资产总计                | 5,850,689.19 | -     | 35,047.98    | -    | -    | 17,158,582.41 | 23,044,319.58 |
| 负债                  |              |       |              |      |      |               |               |
| 应付赎回款               | -            | -     | -            | -    | -    | 23,169.37     | 23,169.37     |
| 应付管理人报酬             | -            | -     | -            | -    | -    | 19,821.28     | 19,821.28     |
| 应付托管费               | -            | -     | -            | -    | -    | 3,964.24      | 3,964.24      |

|         |              |   |           |   |                |               |
|---------|--------------|---|-----------|---|----------------|---------------|
| 应付销售服务费 | -            | - | -         | - | 1,506.72       | 1,506.72      |
| 其他负债    | -            | - | -         | - | 94,342.03      | 94,342.03     |
| 负债总计    | -            | - | -         | - | 142,803.64     | 142,803.64    |
| 利率敏感度缺口 | 5,850,689.19 | - | 35,047.98 | - | -17,015,778.77 | 22,901,515.94 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |  |                             |                        |
|----|--|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | <p>该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；</p> <p>该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；</p> <p>该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；</p> <p>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；</p> <p>卖出回购金融资产的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。</p> |                             |                        |
| 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（2024 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率上升 25 个基点  | -1,552.67                   | 0.00                   |
|    | 市场利率下降 25 个基点  | 1,555.21                    | 0.00                   |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024年6月30日 |                   | 上年度末<br>2023年12月31日 |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|---------------------|-------------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 25,624,526.69     | 72.01             | 17,158,452.41       | 74.92             |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                 | -                 | -                   | -                 |
| 交易性金融资产—债券投资  | 1,934,561.78      | 5.44              | 35,047.98           | 0.15              |
| 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            | 27,559,088.47     | 77.45             | 17,193,500.39       | 75.08             |

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |  |                             |                   |
|----|--|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈现线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； |                             |                   |
|    | 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。   |                             |                   |
| 分析 | 相关风险变量的变动  | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |  | 本期末（2024年6月30日）             | 上年度末（2023年12月31日） |
|    | 沪深 300 上升 1%   | 43,505.27                   | 3,870.66          |
|    | 沪深 300 下降 1%   | -43,505.27                  | -3,870.66         |

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

变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 25,624,526.69     | 17,193,500.39       |
| 第二层次          | 1,934,561.78      | -                   |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 27,559,088.47     | 17,193,500.39       |

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 25,624,526.69 | 71.19         |
|    | 其中：股票             | 25,624,526.69 | 71.19         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,934,561.78  | 5.37          |
|    | 其中：债券             | 1,934,561.78  | 5.37          |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 5,250,928.71  | 14.59         |
| 8  | 其他各项资产            | 3,186,251.46  | 8.85          |
| 9  | 合计                | 35,996,268.64 | 100.00        |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 52,320.00     | 0.15          |
| B  | 采矿业              | 951,231.00    | 2.67          |
| C  | 制造业              | 14,671,416.83 | 41.23         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,034,673.00  | 2.91          |
| E  | 建筑业              | 471,662.00    | 1.33          |
| F  | 批发和零售业           | 483,757.00    | 1.36          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,104,627.20  | 3.10          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,410,554.30  | 6.77          |
| J  | 金融业              | 3,232,217.00  | 9.08          |
| K  | 房地产业             | 295,177.00    | 0.83          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 218,493.00    | 0.61          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 191,457.36    | 0.54          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 199,013.00    | 0.56          |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -             |
| P  | 教育               | -             | -             |



|   |           |               |       |
|---|-----------|---------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作   | 255,643.00    | 0.72  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 52,285.00     | 0.15  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 25,624,526.69 | 72.01 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股）  | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|--------|------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安   | 7,800  | 322,608.00 | 0.91         |
| 2  | 000725 | 京东方 A  | 76,800 | 314,112.00 | 0.88         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台   | 200    | 293,478.00 | 0.82         |
| 4  | 600941 | 中国移动   | 2,700  | 290,250.00 | 0.82         |
| 5  | 601398 | 工商银行   | 40,200 | 229,140.00 | 0.64         |
| 6  | 600025 | 华能水电   | 20,600 | 222,068.00 | 0.62         |
| 7  | 601169 | 北京银行   | 37,500 | 219,000.00 | 0.62         |
| 8  | 000100 | TCL 科技 | 48,800 | 210,816.00 | 0.59         |
| 9  | 601229 | 上海银行   | 28,300 | 205,458.00 | 0.58         |
| 10 | 000651 | 格力电器   | 5,100  | 200,022.00 | 0.56         |
| 11 | 000338 | 潍柴动力   | 12,300 | 199,752.00 | 0.56         |
| 12 | 601989 | 中国重工   | 40,400 | 199,172.00 | 0.56         |
| 13 | 600887 | 伊利股份   | 7,600  | 196,384.00 | 0.55         |
| 14 | 000166 | 申万宏源   | 43,700 | 188,347.00 | 0.53         |
| 15 | 601319 | 中国人保   | 35,500 | 182,825.00 | 0.51         |
| 16 | 000333 | 美的集团   | 2,800  | 180,600.00 | 0.51         |
| 17 | 000895 | 双汇发展   | 7,000  | 166,390.00 | 0.47         |
| 18 | 300080 | 易成新能   | 57,500 | 165,600.00 | 0.47         |
| 19 | 002212 | 天融信    | 33,300 | 162,171.00 | 0.46         |
| 20 | 300750 | 宁德时代   | 900    | 162,027.00 | 0.46         |
| 21 | 600900 | 长江电力   | 5,600  | 161,952.00 | 0.46         |
| 22 | 002415 | 海康威视   | 5,200  | 160,732.00 | 0.45         |
| 23 | 300122 | 智飞生物   | 5,500  | 154,165.00 | 0.43         |
| 24 | 300323 | 华灿光电   | 35,400 | 153,990.00 | 0.43         |
| 25 | 600019 | 宝钢股份   | 22,900 | 152,285.00 | 0.43         |
| 26 | 601857 | 中国石油   | 14,600 | 150,672.00 | 0.42         |
| 27 | 002410 | 广联达    | 15,400 | 147,532.00 | 0.41         |
| 28 | 600018 | 上港集团   | 25,000 | 144,500.00 | 0.41         |
| 29 | 601668 | 中国建筑   | 25,800 | 136,998.00 | 0.38         |
| 30 | 600015 | 华夏银行   | 21,000 | 134,400.00 | 0.38         |
| 31 | 002291 | 遥望科技   | 31,200 | 134,160.00 | 0.38         |
| 32 | 601009 | 南京银行   | 12,700 | 131,953.00 | 0.37         |

|    |        |       |        |            |      |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 33 | 601816 | 京沪高铁  | 24,300 | 130,491.00 | 0.37 |
| 34 | 600812 | 华北制药  | 31,300 | 128,956.00 | 0.36 |
| 35 | 688177 | 百奥泰   | 6,100  | 128,832.00 | 0.36 |
| 36 | 688700 | 东威科技  | 4,900  | 128,429.00 | 0.36 |
| 37 | 600809 | 山西汾酒  | 600    | 126,528.00 | 0.36 |
| 38 | 600595 | 中孚实业  | 50,500 | 125,745.00 | 0.35 |
| 39 | 603806 | 福斯特   | 8,460  | 124,362.00 | 0.35 |
| 40 | 601728 | 中国电信  | 20,100 | 123,615.00 | 0.35 |
| 41 | 002466 | 天齐锂业  | 4,100  | 122,631.00 | 0.34 |
| 42 | 002219 | 新里程   | 65,800 | 122,388.00 | 0.34 |
| 43 | 002488 | 金固股份  | 27,700 | 121,603.00 | 0.34 |
| 44 | 688161 | 威高骨科  | 6,100  | 120,902.00 | 0.34 |
| 45 | 601865 | 福莱特   | 6,000  | 120,600.00 | 0.34 |
| 46 | 600919 | 江苏银行  | 16,000 | 118,880.00 | 0.33 |
| 47 | 688392 | 骄成超声  | 2,800  | 118,832.00 | 0.33 |
| 48 | 600028 | 中国石化  | 18,800 | 118,816.00 | 0.33 |
| 49 | 601601 | 中国太保  | 4,200  | 117,012.00 | 0.33 |
| 50 | 000761 | 本钢板材  | 44,800 | 112,448.00 | 0.32 |
| 51 | 300134 | 大富科技  | 15,700 | 107,074.00 | 0.30 |
| 52 | 000157 | 中联重科  | 13,900 | 106,752.00 | 0.30 |
| 53 | 001236 | 弘业期货  | 14,800 | 105,228.00 | 0.30 |
| 54 | 000727 | 冠捷科技  | 51,000 | 105,060.00 | 0.30 |
| 55 | 600037 | 歌华有线  | 17,300 | 103,454.00 | 0.29 |
| 56 | 000800 | 一汽解放  | 13,100 | 102,573.00 | 0.29 |
| 57 | 603489 | 八方股份  | 3,800  | 102,524.00 | 0.29 |
| 58 | 000538 | 云南白药  | 2,000  | 102,300.00 | 0.29 |
| 59 | 601939 | 建设银行  | 13,700 | 101,380.00 | 0.28 |
| 60 | 002978 | 安宁股份  | 3,600  | 100,296.00 | 0.28 |
| 61 | 002265 | 建设工业  | 11,500 | 99,245.00  | 0.28 |
| 62 | 601868 | 中国能建  | 46,600 | 98,792.00  | 0.28 |
| 63 | 600989 | 宝丰能源  | 5,700  | 98,781.00  | 0.28 |
| 64 | 688400 | 凌云光   | 5,900  | 98,412.00  | 0.28 |
| 65 | 000016 | 深康佳 A | 45,400 | 96,702.00  | 0.27 |
| 66 | 600926 | 杭州银行  | 7,400  | 96,570.00  | 0.27 |
| 67 | 002549 | 凯美特气  | 18,700 | 95,557.00  | 0.27 |
| 68 | 002498 | 汉缆股份  | 28,600 | 94,094.00  | 0.26 |
| 69 | 601288 | 农业银行  | 21,500 | 93,740.00  | 0.26 |
| 70 | 600717 | 天津港   | 21,900 | 93,513.00  | 0.26 |
| 71 | 300432 | 富临精工  | 14,400 | 92,736.00  | 0.26 |
| 72 | 600406 | 国电南瑞  | 3,600  | 89,856.00  | 0.25 |
| 73 | 002100 | 天康生物  | 12,800 | 88,704.00  | 0.25 |
| 74 | 002745 | 木林森   | 11,000 | 88,660.00  | 0.25 |
| 75 | 000028 | 国药一致  | 2,700  | 87,021.00  | 0.24 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 76  | 601908 | 京运通  | 34,200 | 86,526.00 | 0.24 |
| 77  | 301090 | 华润材料 | 13,100 | 86,198.00 | 0.24 |
| 78  | 300142 | 沃森生物 | 7,500  | 85,350.00 | 0.24 |
| 79  | 600547 | 山东黄金 | 3,100  | 84,878.00 | 0.24 |
| 80  | 600688 | 上海石化 | 32,100 | 83,781.00 | 0.24 |
| 81  | 688007 | 光峰科技 | 5,200  | 83,720.00 | 0.24 |
| 82  | 600089 | 特变电工 | 6,000  | 83,220.00 | 0.23 |
| 83  | 601225 | 陕西煤业 | 3,200  | 82,464.00 | 0.23 |
| 84  | 600252 | 中恒集团 | 37,700 | 81,809.00 | 0.23 |
| 85  | 301239 | 普瑞眼科 | 2,300  | 81,259.00 | 0.23 |
| 86  | 301268 | 铭利达  | 5,200  | 80,860.00 | 0.23 |
| 87  | 600588 | 用友网络 | 8,000  | 80,000.00 | 0.22 |
| 88  | 600623 | 华谊集团 | 13,800 | 79,764.00 | 0.22 |
| 89  | 603985 | 恒润股份 | 6,700  | 79,730.00 | 0.22 |
| 90  | 600745 | 闻泰科技 | 2,800  | 79,100.00 | 0.22 |
| 91  | 300451 | 创业慧康 | 22,700 | 78,542.00 | 0.22 |
| 92  | 000088 | 盐田港  | 17,200 | 77,916.00 | 0.22 |
| 93  | 601015 | 陕西黑猫 | 27,800 | 77,840.00 | 0.22 |
| 94  | 600100 | 同方股份 | 15,100 | 76,859.00 | 0.22 |
| 95  | 002252 | 上海莱士 | 9,800  | 76,636.00 | 0.22 |
| 96  | 300973 | 立高食品 | 2,700  | 75,843.00 | 0.21 |
| 97  | 688660 | 电气风电 | 26,300 | 75,744.00 | 0.21 |
| 98  | 301035 | 润丰股份 | 1,700  | 75,718.00 | 0.21 |
| 99  | 688232 | 新点软件 | 3,800  | 74,936.00 | 0.21 |
| 100 | 600997 | 开滦股份 | 10,900 | 74,774.00 | 0.21 |
| 101 | 300379 | 东方通  | 9,200  | 74,336.00 | 0.21 |
| 102 | 688707 | 振华新材 | 7,600  | 74,024.00 | 0.21 |
| 103 | 688981 | 中芯国际 | 1,600  | 73,760.00 | 0.21 |
| 104 | 600267 | 海正药业 | 10,500 | 73,710.00 | 0.21 |
| 105 | 600104 | 上汽集团 | 5,300  | 73,458.00 | 0.21 |
| 106 | 600219 | 南山铝业 | 19,200 | 73,152.00 | 0.21 |
| 107 | 000568 | 泸州老窖 | 500    | 71,745.00 | 0.20 |
| 108 | 688303 | 大全能源 | 3,500  | 71,365.00 | 0.20 |
| 109 | 002241 | 歌尔股份 | 3,600  | 70,236.00 | 0.20 |
| 110 | 601006 | 大秦铁路 | 9,800  | 70,168.00 | 0.20 |
| 111 | 688105 | 诺唯赞  | 3,500  | 70,035.00 | 0.20 |
| 112 | 002453 | 华软科技 | 16,300 | 69,927.00 | 0.20 |
| 113 | 000927 | 中国铁物 | 29,200 | 69,496.00 | 0.20 |
| 114 | 600185 | 格力地产 | 16,200 | 68,850.00 | 0.19 |
| 115 | 601012 | 隆基绿能 | 4,900  | 68,698.00 | 0.19 |
| 116 | 601609 | 金田股份 | 12,100 | 68,486.00 | 0.19 |
| 117 | 301155 | 海力风电 | 1,700  | 68,391.00 | 0.19 |
| 118 | 601988 | 中国银行 | 14,600 | 67,452.00 | 0.19 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 119 | 300369 | 绿盟科技 | 13,100 | 66,941.00 | 0.19 |
| 120 | 002461 | 珠江啤酒 | 8,900  | 66,038.00 | 0.19 |
| 121 | 000550 | 江铃汽车 | 3,000  | 65,130.00 | 0.18 |
| 122 | 002123 | 梦网科技 | 9,200  | 64,676.00 | 0.18 |
| 123 | 300257 | 开山股份 | 6,400  | 64,640.00 | 0.18 |
| 124 | 002541 | 鸿路钢构 | 3,800  | 64,486.00 | 0.18 |
| 125 | 688315 | 诺禾致源 | 5,833  | 63,696.36 | 0.18 |
| 126 | 300587 | 天铁股份 | 15,600 | 63,024.00 | 0.18 |
| 127 | 688383 | 新益昌  | 1,200  | 62,532.00 | 0.18 |
| 128 | 000869 | 张裕 A | 2,900  | 61,915.00 | 0.17 |
| 129 | 601899 | 紫金矿业 | 3,500  | 61,495.00 | 0.17 |
| 130 | 000657 | 中钨高新 | 6,700  | 61,238.00 | 0.17 |
| 131 | 601898 | 中煤能源 | 4,900  | 61,152.00 | 0.17 |
| 132 | 600556 | 天下秀  | 16,600 | 60,424.00 | 0.17 |
| 133 | 600123 | 兰花科创 | 6,700  | 59,965.00 | 0.17 |
| 134 | 600420 | 国药现代 | 5,600  | 59,808.00 | 0.17 |
| 135 | 603501 | 韦尔股份 | 600    | 59,622.00 | 0.17 |
| 136 | 688561 | 奇安信  | 2,500  | 59,050.00 | 0.17 |
| 137 | 300123 | 亚光科技 | 12,700 | 58,928.00 | 0.17 |
| 138 | 603071 | 物产环能 | 4,700  | 58,891.00 | 0.17 |
| 139 | 002724 | 海洋王  | 13,200 | 58,740.00 | 0.17 |
| 140 | 601916 | 浙商银行 | 21,200 | 58,512.00 | 0.16 |
| 141 | 300760 | 迈瑞医疗 | 200    | 58,182.00 | 0.16 |
| 142 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,500  | 57,690.00 | 0.16 |
| 143 | 600188 | 兖矿能源 | 2,500  | 56,825.00 | 0.16 |
| 144 | 301217 | 铜冠铜箔 | 5,900  | 56,640.00 | 0.16 |
| 145 | 000582 | 北部湾港 | 7,600  | 56,544.00 | 0.16 |
| 146 | 688739 | 成大生物 | 2,300  | 55,752.00 | 0.16 |
| 147 | 601633 | 长城汽车 | 2,200  | 55,660.00 | 0.16 |
| 148 | 301207 | 华兰疫苗 | 3,100  | 54,777.00 | 0.15 |
| 149 | 002421 | 达实智能 | 23,500 | 54,755.00 | 0.15 |
| 150 | 002601 | 龙佰集团 | 2,900  | 53,853.00 | 0.15 |
| 151 | 688110 | 东芯股份 | 2,800  | 53,396.00 | 0.15 |
| 152 | 600795 | 国电电力 | 8,900  | 53,311.00 | 0.15 |
| 153 | 600888 | 新疆众和 | 7,500  | 53,025.00 | 0.15 |
| 154 | 000503 | 国新健康 | 7,900  | 52,693.00 | 0.15 |
| 155 | 600770 | 综艺股份 | 23,000 | 52,670.00 | 0.15 |
| 156 | 688388 | 嘉元科技 | 5,400  | 52,650.00 | 0.15 |
| 157 | 002714 | 牧原股份 | 1,200  | 52,320.00 | 0.15 |
| 158 | 600061 | 国投资本 | 9,200  | 51,980.00 | 0.15 |
| 159 | 600233 | 圆通速递 | 3,300  | 51,645.00 | 0.15 |
| 160 | 601360 | 三六零  | 6,700  | 51,456.00 | 0.14 |
| 161 | 002390 | 信邦制药 | 15,500 | 51,305.00 | 0.14 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 162 | 000858 | 五 粮 液 | 400    | 51,216.00 | 0.14 |
| 163 | 600048 | 保利发展  | 5,800  | 50,808.00 | 0.14 |
| 164 | 300088 | 长信科技  | 10,800 | 50,760.00 | 0.14 |
| 165 | 603567 | 珍宝岛   | 4,800  | 50,544.00 | 0.14 |
| 166 | 002648 | 卫星化学  | 2,800  | 50,344.00 | 0.14 |
| 167 | 000069 | 华侨城 A | 24,500 | 49,980.00 | 0.14 |
| 168 | 000029 | 深深房 A | 4,700  | 49,961.00 | 0.14 |
| 169 | 002354 | 天娱数科  | 16,700 | 49,933.00 | 0.14 |
| 170 | 601107 | 四川成渝  | 9,500  | 49,875.00 | 0.14 |
| 171 | 688776 | 国光电气  | 900    | 49,860.00 | 0.14 |
| 172 | 600320 | 振华重工  | 14,500 | 49,590.00 | 0.14 |
| 173 | 688432 | 有研硅   | 5,100  | 49,419.00 | 0.14 |
| 174 | 688321 | 微芯生物  | 2,782  | 48,963.20 | 0.14 |
| 175 | 301069 | 凯盛新材  | 3,700  | 48,507.00 | 0.14 |
| 176 | 600403 | 大有能源  | 18,800 | 48,504.00 | 0.14 |
| 177 | 600728 | 佳都科技  | 13,000 | 48,230.00 | 0.14 |
| 178 | 601963 | 重庆银行  | 6,200  | 48,050.00 | 0.14 |
| 179 | 688567 | 孚能科技  | 5,000  | 48,000.00 | 0.13 |
| 180 | 000813 | 德展健康  | 22,900 | 47,632.00 | 0.13 |
| 181 | 002434 | 万里扬   | 9,700  | 47,530.00 | 0.13 |
| 182 | 688362 | 甬矽电子  | 2,433  | 47,346.18 | 0.13 |
| 183 | 002311 | 海大集团  | 1,000  | 47,050.00 | 0.13 |
| 184 | 003816 | 中国广核  | 10,100 | 46,763.00 | 0.13 |
| 185 | 002567 | 唐人神   | 8,700  | 46,632.00 | 0.13 |
| 186 | 601818 | 光大银行  | 14,600 | 46,282.00 | 0.13 |
| 187 | 601607 | 上海医药  | 2,400  | 45,864.00 | 0.13 |
| 188 | 600908 | 无锡银行  | 8,600  | 45,752.00 | 0.13 |
| 189 | 600098 | 广州发展  | 7,100  | 45,440.00 | 0.13 |
| 190 | 688185 | 康希诺   | 1,100  | 45,199.00 | 0.13 |
| 191 | 000061 | 农 产 品 | 9,300  | 45,198.00 | 0.13 |
| 192 | 600740 | 山西焦化  | 11,500 | 45,080.00 | 0.13 |
| 193 | 600023 | 浙能电力  | 6,300  | 44,793.00 | 0.13 |
| 194 | 600269 | 赣粤高速  | 8,600  | 44,462.00 | 0.12 |
| 195 | 601838 | 成都银行  | 2,900  | 44,051.00 | 0.12 |
| 196 | 603871 | 嘉友国际  | 2,480  | 43,871.20 | 0.12 |
| 197 | 000597 | 东北制药  | 11,200 | 43,344.00 | 0.12 |
| 198 | 000030 | 富奥股份  | 8,800  | 43,208.00 | 0.12 |
| 199 | 605499 | 东鹏饮料  | 200    | 43,150.00 | 0.12 |
| 200 | 000415 | 渤海租赁  | 16,900 | 43,095.00 | 0.12 |
| 201 | 002948 | 青岛银行  | 12,700 | 42,799.00 | 0.12 |
| 202 | 600409 | 三友化工  | 8,500  | 42,670.00 | 0.12 |
| 203 | 600610 | 中毅达   | 10,700 | 42,586.00 | 0.12 |
| 204 | 002283 | 天润工业  | 9,900  | 42,471.00 | 0.12 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 205 | 002545 | 东方铁塔 | 6,100  | 41,541.00 | 0.12 |
| 206 | 688031 | 星环科技 | 1,130  | 41,482.30 | 0.12 |
| 207 | 688275 | 万润新能 | 1,400  | 41,188.00 | 0.12 |
| 208 | 601828 | 美凯龙  | 16,100 | 41,055.00 | 0.12 |
| 209 | 603033 | 三维股份 | 3,500  | 40,950.00 | 0.12 |
| 210 | 000012 | 南玻 A | 8,100  | 40,824.00 | 0.11 |
| 211 | 002249 | 大洋电机 | 8,600  | 40,678.00 | 0.11 |
| 212 | 002585 | 双星新材 | 8,200  | 40,672.00 | 0.11 |
| 213 | 600481 | 双良节能 | 8,700  | 40,629.00 | 0.11 |
| 214 | 603733 | 仙鹤股份 | 2,300  | 40,434.00 | 0.11 |
| 215 | 001323 | 慕思股份 | 1,400  | 40,278.00 | 0.11 |
| 216 | 688322 | 奥比中光 | 1,500  | 40,065.00 | 0.11 |
| 217 | 002416 | 爱施德  | 4,500  | 39,825.00 | 0.11 |
| 218 | 002065 | 东华软件 | 8,800  | 39,776.00 | 0.11 |
| 219 | 688276 | 百克生物 | 1,400  | 39,718.00 | 0.11 |
| 220 | 600115 | 中国东航 | 9,900  | 39,699.00 | 0.11 |
| 221 | 601600 | 中国铝业 | 5,200  | 39,676.00 | 0.11 |
| 222 | 002440 | 闰土股份 | 7,300  | 39,639.00 | 0.11 |
| 223 | 000795 | 英洛华  | 7,100  | 39,334.00 | 0.11 |
| 224 | 688372 | 伟测科技 | 1,000  | 39,330.00 | 0.11 |
| 225 | 601766 | 中国中车 | 5,200  | 39,052.00 | 0.11 |
| 226 | 600761 | 安徽合力 | 1,800  | 38,952.00 | 0.11 |
| 227 | 601330 | 绿色动力 | 6,500  | 37,830.00 | 0.11 |
| 228 | 601800 | 中国交建 | 4,200  | 37,548.00 | 0.11 |
| 229 | 002516 | 旷达科技 | 10,300 | 37,492.00 | 0.11 |
| 230 | 600026 | 中远海能 | 2,400  | 37,464.00 | 0.11 |
| 231 | 002701 | 奥瑞金  | 9,000  | 37,440.00 | 0.11 |
| 232 | 301177 | 迪阿股份 | 2,000  | 37,200.00 | 0.10 |
| 233 | 000600 | 建投能源 | 5,900  | 37,170.00 | 0.10 |
| 234 | 603345 | 安井食品 | 500    | 37,155.00 | 0.10 |
| 235 | 000685 | 中山公用 | 5,100  | 36,771.00 | 0.10 |
| 236 | 601236 | 红塔证券 | 5,700  | 36,594.00 | 0.10 |
| 237 | 601279 | 英利汽车 | 9,800  | 36,554.00 | 0.10 |
| 238 | 600918 | 中泰证券 | 6,400  | 36,288.00 | 0.10 |
| 239 | 300015 | 爱尔眼科 | 3,500  | 36,120.00 | 0.10 |
| 240 | 600017 | 日照港  | 13,500 | 36,045.00 | 0.10 |
| 241 | 600366 | 宁波韵升 | 6,900  | 36,018.00 | 0.10 |
| 242 | 600674 | 川投能源 | 1,900  | 35,625.00 | 0.10 |
| 243 | 688037 | 芯源微  | 400    | 35,600.00 | 0.10 |
| 244 | 603881 | 数据港  | 2,800  | 35,588.00 | 0.10 |
| 245 | 300999 | 金龙鱼  | 1,300  | 35,555.00 | 0.10 |
| 246 | 002153 | 石基信息 | 6,200  | 35,526.00 | 0.10 |
| 247 | 601088 | 中国神华 | 800    | 35,496.00 | 0.10 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 248 | 002807 | 江阴银行  | 9,400  | 35,438.00 | 0.10 |
| 249 | 000429 | 粤高速 A | 3,400  | 35,394.00 | 0.10 |
| 250 | 601658 | 邮储银行  | 6,900  | 34,983.00 | 0.10 |
| 251 | 688515 | 裕太微   | 600    | 34,800.00 | 0.10 |
| 252 | 002493 | 荣盛石化  | 3,600  | 34,776.00 | 0.10 |
| 253 | 301286 | 侨源股份  | 1,200  | 34,332.00 | 0.10 |
| 254 | 600959 | 江苏有线  | 12,900 | 34,056.00 | 0.10 |
| 255 | 300639 | 凯普生物  | 7,400  | 34,040.00 | 0.10 |
| 256 | 688333 | 铂力特   | 700    | 33,915.00 | 0.10 |
| 257 | 600967 | 内蒙一机  | 4,700  | 33,840.00 | 0.10 |
| 258 | 601021 | 春秋航空  | 600    | 33,798.00 | 0.09 |
| 259 | 300832 | 新产业   | 500    | 33,720.00 | 0.09 |
| 260 | 600391 | 航发科技  | 2,200  | 33,550.00 | 0.09 |
| 261 | 688516 | 奥特维   | 800    | 33,448.00 | 0.09 |
| 262 | 600618 | 氯碱化工  | 3,800  | 33,364.00 | 0.09 |
| 263 | 601187 | 厦门银行  | 6,200  | 33,046.00 | 0.09 |
| 264 | 688167 | 炬光科技  | 600    | 33,000.00 | 0.09 |
| 265 | 002583 | 海能达   | 8,100  | 32,967.00 | 0.09 |
| 266 | 603093 | 南华期货  | 3,800  | 32,908.00 | 0.09 |
| 267 | 600030 | 中信证券  | 1,800  | 32,814.00 | 0.09 |
| 268 | 300573 | 兴齐眼药  | 200    | 32,800.00 | 0.09 |
| 269 | 300737 | 科顺股份  | 7,600  | 32,680.00 | 0.09 |
| 270 | 600820 | 隧道股份  | 5,000  | 32,650.00 | 0.09 |
| 271 | 600667 | 太极实业  | 5,700  | 32,547.00 | 0.09 |
| 272 | 000401 | 冀东水泥  | 8,000  | 32,480.00 | 0.09 |
| 273 | 603185 | 弘元绿能  | 1,900  | 32,471.00 | 0.09 |
| 274 | 300296 | 利亚德   | 7,200  | 32,400.00 | 0.09 |
| 275 | 600179 | 安通控股  | 13,900 | 32,387.00 | 0.09 |
| 276 | 603713 | 密尔克卫  | 600    | 32,112.00 | 0.09 |
| 277 | 002371 | 北方华创  | 100    | 31,989.00 | 0.09 |
| 278 | 688586 | 江航装备  | 3,400  | 31,620.00 | 0.09 |
| 279 | 301200 | 大族数控  | 1,000  | 31,560.00 | 0.09 |
| 280 | 601200 | 上海环境  | 3,700  | 31,450.00 | 0.09 |
| 281 | 601718 | 际华集团  | 12,600 | 31,248.00 | 0.09 |
| 282 | 600741 | 华域汽车  | 1,900  | 31,122.00 | 0.09 |
| 283 | 600578 | 京能电力  | 9,600  | 31,104.00 | 0.09 |
| 284 | 002649 | 博彦科技  | 3,900  | 31,044.00 | 0.09 |
| 285 | 002240 | 盛新锂能  | 2,300  | 30,866.00 | 0.09 |
| 286 | 688002 | 睿创微纳  | 1,100  | 30,767.00 | 0.09 |
| 287 | 688639 | 华恒生物  | 400    | 30,556.00 | 0.09 |
| 288 | 603297 | 永新光学  | 500    | 30,245.00 | 0.08 |
| 289 | 601949 | 中国出版  | 5,100  | 30,141.00 | 0.08 |
| 290 | 688220 | 翱捷科技  | 800    | 29,968.00 | 0.08 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 291 | 688187 | 时代电气 | 600    | 29,628.00 | 0.08 |
| 292 | 603766 | 隆鑫通用 | 4,300  | 29,154.00 | 0.08 |
| 293 | 002163 | 海南发展 | 5,300  | 29,044.00 | 0.08 |
| 294 | 601375 | 中原证券 | 8,500  | 28,985.00 | 0.08 |
| 295 | 001203 | 大中矿业 | 3,000  | 28,830.00 | 0.08 |
| 296 | 301327 | 华宝新能 | 500    | 28,650.00 | 0.08 |
| 297 | 002135 | 东南网架 | 7,200  | 28,512.00 | 0.08 |
| 298 | 002048 | 宁波华翔 | 2,200  | 28,468.00 | 0.08 |
| 299 | 600362 | 江西铜业 | 1,200  | 28,416.00 | 0.08 |
| 300 | 601212 | 白银有色 | 10,200 | 28,356.00 | 0.08 |
| 301 | 000848 | 承德露露 | 3,600  | 28,296.00 | 0.08 |
| 302 | 601166 | 兴业银行 | 1,600  | 28,192.00 | 0.08 |
| 303 | 605123 | 派克新材 | 500    | 28,090.00 | 0.08 |
| 304 | 600110 | 诺德股份 | 9,200  | 28,060.00 | 0.08 |
| 305 | 601778 | 晶科科技 | 12,300 | 28,044.00 | 0.08 |
| 306 | 688023 | 安恒信息 | 700    | 28,007.00 | 0.08 |
| 307 | 688502 | 茂莱光学 | 300    | 27,903.00 | 0.08 |
| 308 | 601919 | 中远海控 | 1,800  | 27,882.00 | 0.08 |
| 309 | 600452 | 涪陵电力 | 2,200  | 27,874.00 | 0.08 |
| 310 | 001322 | 箭牌家居 | 3,800  | 27,778.00 | 0.08 |
| 311 | 300158 | 振东制药 | 7,200  | 27,504.00 | 0.08 |
| 312 | 000825 | 太钢不锈 | 8,100  | 27,378.00 | 0.08 |
| 313 | 600161 | 天坛生物 | 1,120  | 27,328.00 | 0.08 |
| 314 | 688262 | 国芯科技 | 1,500  | 27,315.00 | 0.08 |
| 315 | 600507 | 方大特钢 | 7,300  | 27,302.00 | 0.08 |
| 316 | 600810 | 神马股份 | 4,400  | 27,280.00 | 0.08 |
| 317 | 603906 | 龙蟠科技 | 3,500  | 27,265.00 | 0.08 |
| 318 | 600000 | 浦发银行 | 3,300  | 27,159.00 | 0.08 |
| 319 | 600399 | 抚顺特钢 | 4,800  | 27,024.00 | 0.08 |
| 320 | 600169 | 太原重工 | 14,600 | 26,718.00 | 0.08 |
| 321 | 002050 | 三花智控 | 1,400  | 26,712.00 | 0.08 |
| 322 | 603638 | 艾迪精密 | 1,900  | 26,657.00 | 0.07 |
| 323 | 601995 | 中金公司 | 900    | 26,649.00 | 0.07 |
| 324 | 605507 | 国邦医药 | 1,600  | 26,640.00 | 0.07 |
| 325 | 688158 | 优刻得  | 2,600  | 26,598.00 | 0.07 |
| 326 | 603799 | 华友钴业 | 1,200  | 26,556.00 | 0.07 |
| 327 | 300026 | 红日药业 | 8,700  | 26,535.00 | 0.07 |
| 328 | 688033 | 天宜上佳 | 4,400  | 26,400.00 | 0.07 |
| 329 | 688676 | 金盘科技 | 500    | 26,075.00 | 0.07 |
| 330 | 001213 | 中铁特货 | 6,600  | 26,070.00 | 0.07 |
| 331 | 688153 | 唯捷创芯 | 700    | 25,900.00 | 0.07 |
| 332 | 600707 | 彩虹股份 | 3,800  | 25,878.00 | 0.07 |
| 333 | 002901 | 大博医疗 | 1,000  | 25,830.00 | 0.07 |



|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 334 | 603233 | 大参林   | 1,800  | 25,740.00 | 0.07 |
| 335 | 603108 | 润达医疗  | 1,700  | 25,738.00 | 0.07 |
| 336 | 300850 | 新强联   | 1,700  | 25,534.00 | 0.07 |
| 337 | 000050 | 深天马 A | 3,500  | 25,480.00 | 0.07 |
| 338 | 688598 | 金博股份  | 900    | 25,470.00 | 0.07 |
| 339 | 002961 | 瑞达期货  | 2,300  | 25,185.00 | 0.07 |
| 340 | 688147 | 微导纳米  | 1,000  | 24,900.00 | 0.07 |
| 341 | 000027 | 深圳能源  | 3,400  | 24,820.00 | 0.07 |
| 342 | 300303 | 聚飞光电  | 5,100  | 24,786.00 | 0.07 |
| 343 | 601877 | 正泰电器  | 1,300  | 24,778.00 | 0.07 |
| 344 | 601777 | 力帆科技  | 6,400  | 24,576.00 | 0.07 |
| 345 | 601985 | 中国核电  | 2,300  | 24,518.00 | 0.07 |
| 346 | 603728 | 鸣志电器  | 600    | 24,138.00 | 0.07 |
| 347 | 002839 | 张家港行  | 6,000  | 24,120.00 | 0.07 |
| 348 | 600284 | 浦东建设  | 4,500  | 24,030.00 | 0.07 |
| 349 | 000810 | 创维数字  | 2,800  | 24,024.00 | 0.07 |
| 350 | 601336 | 新华保险  | 800    | 24,024.00 | 0.07 |
| 351 | 600660 | 福耀玻璃  | 500    | 23,950.00 | 0.07 |
| 352 | 000983 | 山西焦煤  | 2,300  | 23,713.00 | 0.07 |
| 353 | 000913 | 钱江摩托  | 1,500  | 23,640.00 | 0.07 |
| 354 | 002335 | 科华数据  | 1,100  | 23,243.00 | 0.07 |
| 355 | 002489 | 浙江永强  | 9,800  | 23,226.00 | 0.07 |
| 356 | 603876 | 鼎胜新材  | 2,500  | 23,175.00 | 0.07 |
| 357 | 600718 | 东软集团  | 2,800  | 23,156.00 | 0.07 |
| 358 | 601186 | 中国铁建  | 2,700  | 23,139.00 | 0.07 |
| 359 | 002467 | 二六三   | 6,900  | 23,046.00 | 0.06 |
| 360 | 000723 | 美锦能源  | 4,800  | 22,848.00 | 0.06 |
| 361 | 600901 | 江苏金租  | 4,500  | 22,725.00 | 0.06 |
| 362 | 688337 | 普源精电  | 900    | 22,698.00 | 0.06 |
| 363 | 300267 | 尔康制药  | 10,900 | 22,672.00 | 0.06 |
| 364 | 600535 | 天士力   | 1,800  | 22,644.00 | 0.06 |
| 365 | 600782 | 新钢股份  | 6,800  | 22,576.00 | 0.06 |
| 366 | 002396 | 星网锐捷  | 1,700  | 22,457.00 | 0.06 |
| 367 | 603103 | 横店影视  | 1,600  | 22,144.00 | 0.06 |
| 368 | 002007 | 华兰生物  | 1,400  | 22,106.00 | 0.06 |
| 369 | 603666 | 亿嘉和   | 1,400  | 22,092.00 | 0.06 |
| 370 | 300628 | 亿联网络  | 600    | 22,062.00 | 0.06 |
| 371 | 600600 | 青岛啤酒  | 300    | 21,831.00 | 0.06 |
| 372 | 603712 | 七一二   | 1,200  | 21,828.00 | 0.06 |
| 373 | 000408 | 藏格矿业  | 900    | 21,663.00 | 0.06 |
| 374 | 601997 | 贵阳银行  | 4,100  | 21,607.00 | 0.06 |
| 375 | 605222 | 起帆电缆  | 1,400  | 21,476.00 | 0.06 |
| 376 | 300741 | 华宝股份  | 1,400  | 21,336.00 | 0.06 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 377 | 600963 | 岳阳林纸 | 5,800 | 21,286.00 | 0.06 |
| 378 | 601326 | 秦港股份 | 6,700 | 21,239.00 | 0.06 |
| 379 | 002180 | 纳思达  | 800   | 21,136.00 | 0.06 |
| 380 | 001979 | 招商蛇口 | 2,400 | 21,096.00 | 0.06 |
| 381 | 002020 | 京新药业 | 2,000 | 20,940.00 | 0.06 |
| 382 | 002791 | 坚朗五金 | 800   | 20,696.00 | 0.06 |
| 383 | 300382 | 斯莱克  | 3,500 | 20,685.00 | 0.06 |
| 384 | 000923 | 河钢资源 | 1,200 | 20,664.00 | 0.06 |
| 385 | 601665 | 齐鲁银行 | 4,200 | 20,622.00 | 0.06 |
| 386 | 301316 | 慧博云通 | 1,400 | 20,552.00 | 0.06 |
| 387 | 002004 | 华邦健康 | 5,400 | 20,520.00 | 0.06 |
| 388 | 002060 | 广东建工 | 6,000 | 20,520.00 | 0.06 |
| 389 | 300755 | 华致酒行 | 1,500 | 20,490.00 | 0.06 |
| 390 | 000543 | 皖能电力 | 2,300 | 20,355.00 | 0.06 |
| 391 | 688295 | 中复神鹰 | 1,000 | 20,300.00 | 0.06 |
| 392 | 301262 | 海看股份 | 900   | 20,295.00 | 0.06 |
| 393 | 000951 | 中国重汽 | 1,400 | 20,048.00 | 0.06 |
| 394 | 600863 | 内蒙华电 | 4,300 | 19,952.00 | 0.06 |
| 395 | 688209 | 英集芯  | 1,600 | 19,856.00 | 0.06 |
| 396 | 600050 | 中国联通 | 4,200 | 19,740.00 | 0.06 |
| 397 | 600510 | 黑牡丹  | 5,300 | 19,716.00 | 0.06 |
| 398 | 600662 | 外服控股 | 4,900 | 19,649.00 | 0.06 |
| 399 | 000557 | 西部创业 | 5,200 | 19,552.00 | 0.05 |
| 400 | 002034 | 旺能环境 | 1,500 | 19,515.00 | 0.05 |
| 401 | 300687 | 赛意信息 | 1,400 | 19,488.00 | 0.05 |
| 402 | 000963 | 华东医药 | 700   | 19,467.00 | 0.05 |
| 403 | 000811 | 冰轮环境 | 2,000 | 19,300.00 | 0.05 |
| 404 | 600248 | 陕建股份 | 5,300 | 19,239.00 | 0.05 |
| 405 | 688387 | 信科移动 | 3,800 | 19,152.00 | 0.05 |
| 406 | 301219 | 腾远钴业 | 500   | 19,130.00 | 0.05 |
| 407 | 600966 | 博汇纸业 | 4,000 | 19,120.00 | 0.05 |
| 408 | 002015 | 协鑫能科 | 2,400 | 19,104.00 | 0.05 |
| 409 | 600584 | 长电科技 | 600   | 19,026.00 | 0.05 |
| 410 | 601038 | 一拖股份 | 1,200 | 18,972.00 | 0.05 |
| 411 | 600557 | 康缘药业 | 1,200 | 18,840.00 | 0.05 |
| 412 | 301015 | 百洋医药 | 800   | 18,824.00 | 0.05 |
| 413 | 600641 | 万业企业 | 1,600 | 18,800.00 | 0.05 |
| 414 | 603323 | 苏农银行 | 3,900 | 18,759.00 | 0.05 |
| 415 | 601158 | 重庆水务 | 3,900 | 18,720.00 | 0.05 |
| 416 | 002539 | 云图控股 | 2,600 | 18,538.00 | 0.05 |
| 417 | 603369 | 今世缘  | 400   | 18,480.00 | 0.05 |
| 418 | 688116 | 天奈科技 | 800   | 18,464.00 | 0.05 |
| 419 | 601881 | 中国银河 | 1,700 | 18,462.00 | 0.05 |

|     |        |       |       |           |      |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 420 | 688408 | 中信博   | 200   | 18,416.00 | 0.05 |
| 421 | 688046 | 药康生物  | 1,800 | 18,396.00 | 0.05 |
| 422 | 603883 | 老百姓   | 1,000 | 18,360.00 | 0.05 |
| 423 | 601163 | 三角轮胎  | 1,200 | 18,264.00 | 0.05 |
| 424 | 300433 | 蓝思科技  | 1,000 | 18,250.00 | 0.05 |
| 425 | 002991 | 甘源食品  | 300   | 18,195.00 | 0.05 |
| 426 | 002681 | 奋达科技  | 4,900 | 17,885.00 | 0.05 |
| 427 | 600927 | 永安期货  | 1,600 | 17,840.00 | 0.05 |
| 428 | 000786 | 北新建材  | 600   | 17,796.00 | 0.05 |
| 429 | 002925 | 盈趣科技  | 1,400 | 17,738.00 | 0.05 |
| 430 | 000553 | 安道麦 A | 3,900 | 17,706.00 | 0.05 |
| 431 | 600780 | 通宝能源  | 3,000 | 17,700.00 | 0.05 |
| 432 | 002960 | 青鸟消防  | 1,400 | 17,696.00 | 0.05 |
| 433 | 603609 | 禾丰股份  | 2,700 | 17,658.00 | 0.05 |
| 434 | 002287 | 奇正藏药  | 900   | 17,622.00 | 0.05 |
| 435 | 600332 | 白云山   | 600   | 17,598.00 | 0.05 |
| 436 | 000301 | 东方盛虹  | 2,200 | 17,534.00 | 0.05 |
| 437 | 000950 | 重药控股  | 3,600 | 17,532.00 | 0.05 |
| 438 | 688733 | 壹石通   | 1,171 | 17,506.45 | 0.05 |
| 439 | 603368 | 柳药集团  | 1,000 | 17,500.00 | 0.05 |
| 440 | 601101 | 昊华能源  | 1,900 | 17,461.00 | 0.05 |
| 441 | 600612 | 老凤祥   | 300   | 17,457.00 | 0.05 |
| 442 | 002573 | 清新环境  | 4,500 | 17,415.00 | 0.05 |
| 443 | 688239 | 航宇科技  | 500   | 17,400.00 | 0.05 |
| 444 | 601688 | 华泰证券  | 1,400 | 17,346.00 | 0.05 |
| 445 | 688088 | 虹软科技  | 600   | 17,316.00 | 0.05 |
| 446 | 300140 | 节能环境  | 2,900 | 17,313.00 | 0.05 |
| 447 | 002019 | 亿帆医药  | 1,400 | 17,304.00 | 0.05 |
| 448 | 000598 | 兴蓉环境  | 2,300 | 17,296.00 | 0.05 |
| 449 | 002061 | 浙江交科  | 4,700 | 17,155.00 | 0.05 |
| 450 | 601059 | 信达证券  | 1,200 | 17,052.00 | 0.05 |
| 451 | 000999 | 华润三九  | 400   | 17,032.00 | 0.05 |
| 452 | 603113 | 金能科技  | 3,100 | 16,957.00 | 0.05 |
| 453 | 000156 | 华数传媒  | 2,700 | 16,956.00 | 0.05 |
| 454 | 000035 | 中国天楹  | 3,700 | 16,761.00 | 0.05 |
| 455 | 600346 | 恒力石化  | 1,200 | 16,740.00 | 0.05 |
| 456 | 002174 | 游族网络  | 2,200 | 16,698.00 | 0.05 |
| 457 | 600008 | 首创环保  | 6,200 | 16,616.00 | 0.05 |
| 458 | 603983 | 丸美股份  | 600   | 16,518.00 | 0.05 |
| 459 | 002950 | 奥美医疗  | 2,500 | 16,500.00 | 0.05 |
| 460 | 600500 | 中化国际  | 4,700 | 16,403.00 | 0.05 |
| 461 | 600150 | 中国船舶  | 400   | 16,284.00 | 0.05 |
| 462 | 300558 | 贝达药业  | 500   | 16,275.00 | 0.05 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 463 | 600309 | 万华化学 | 200   | 16,172.00 | 0.05 |
| 464 | 002385 | 大北农  | 4,200 | 16,170.00 | 0.05 |
| 465 | 000967 | 盈峰环境 | 3,800 | 16,074.00 | 0.05 |
| 466 | 688278 | 特宝生物 | 300   | 16,065.00 | 0.05 |
| 467 | 300383 | 光环新网 | 1,900 | 16,055.00 | 0.05 |
| 468 | 688521 | 芯原股份 | 600   | 16,050.00 | 0.05 |
| 469 | 688538 | 和辉光电 | 8,100 | 16,038.00 | 0.05 |
| 470 | 300014 | 亿纬锂能 | 400   | 15,968.00 | 0.04 |
| 471 | 601155 | 新城控股 | 1,800 | 15,966.00 | 0.04 |
| 472 | 002044 | 美年健康 | 4,200 | 15,876.00 | 0.04 |
| 473 | 300782 | 卓胜微  | 200   | 15,548.00 | 0.04 |
| 474 | 688036 | 传音控股 | 200   | 15,308.00 | 0.04 |
| 475 | 600875 | 东方电气 | 700   | 12,915.00 | 0.04 |
| 476 | 600027 | 华电国际 | 1,800 | 12,492.00 | 0.04 |
| 477 | 000625 | 长安汽车 | 900   | 12,087.00 | 0.03 |
| 478 | 002938 | 鹏鼎控股 | 300   | 11,928.00 | 0.03 |
| 479 | 300408 | 三环集团 | 400   | 11,676.00 | 0.03 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|--------------|----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安   | 1,176,098.00 | 5.14           |
| 2  | 601398 | 工商银行   | 1,173,055.00 | 5.12           |
| 3  | 000100 | TCL 科技 | 1,095,298.00 | 4.78           |
| 4  | 300762 | 上海瀚讯   | 1,032,975.00 | 4.51           |
| 5  | 600406 | 国电南瑞   | 994,478.00   | 4.34           |
| 6  | 600519 | 贵州茅台   | 976,384.00   | 4.26           |
| 7  | 688598 | 金博股份   | 941,023.05   | 4.11           |
| 8  | 688700 | 东威科技   | 918,305.38   | 4.01           |
| 9  | 600887 | 伊利股份   | 878,240.00   | 3.83           |
| 10 | 688680 | 海优新材   | 878,114.43   | 3.83           |
| 11 | 601988 | 中国银行   | 866,275.00   | 3.78           |
| 12 | 688392 | 骄成超声   | 860,614.57   | 3.76           |
| 13 | 300782 | 卓胜微    | 848,418.00   | 3.70           |
| 14 | 601288 | 农业银行   | 822,160.00   | 3.59           |
| 15 | 000651 | 格力电器   | 811,146.00   | 3.54           |
| 16 | 600900 | 长江电力   | 775,974.00   | 3.39           |
| 17 | 601728 | 中国电信   | 771,068.00   | 3.37           |
| 18 | 600919 | 江苏银行   | 760,043.00   | 3.32           |
| 19 | 000725 | 京东方 A  | 742,552.00   | 3.24           |
| 20 | 688110 | 东芯股份   | 734,431.38   | 3.21           |
| 21 | 688031 | 星环科技   | 722,601.75   | 3.16           |

|    |        |        |            |      |
|----|--------|--------|------------|------|
| 22 | 688383 | 新益昌    | 721,463.86 | 3.15 |
| 23 | 688733 | 壹石通    | 716,974.47 | 3.13 |
| 24 | 600696 | 岩石股份   | 701,019.00 | 3.06 |
| 25 | 601615 | 明阳智能   | 698,804.00 | 3.05 |
| 26 | 600028 | 中国石化   | 692,351.00 | 3.02 |
| 27 | 688131 | 皓元医药   | 692,009.72 | 3.02 |
| 28 | 601628 | 中国人寿   | 691,451.00 | 3.02 |
| 29 | 002415 | 海康威视   | 680,459.00 | 2.97 |
| 30 | 601319 | 中国人保   | 678,619.00 | 2.96 |
| 31 | 300760 | 迈瑞医疗   | 668,230.00 | 2.92 |
| 32 | 002410 | 广联达    | 663,583.00 | 2.90 |
| 33 | 601857 | 中国石油   | 661,885.00 | 2.89 |
| 34 | 601138 | 工业富联   | 661,242.00 | 2.89 |
| 35 | 688133 | 泰坦科技   | 656,970.72 | 2.87 |
| 36 | 688238 | 和元生物   | 650,044.98 | 2.84 |
| 37 | 688152 | 麒麟信安   | 644,574.26 | 2.81 |
| 38 | 601939 | 建设银行   | 642,681.00 | 2.81 |
| 39 | 000895 | 双汇发展   | 640,922.00 | 2.80 |
| 40 | 688007 | 光峰科技   | 633,265.71 | 2.77 |
| 41 | 603713 | 密尔克卫   | 632,589.00 | 2.76 |
| 42 | 688707 | 振华新材   | 630,155.02 | 2.75 |
| 43 | 002812 | 恩捷股份   | 624,859.00 | 2.73 |
| 44 | 300973 | 立高食品   | 622,882.00 | 2.72 |
| 45 | 688166 | 博瑞医药   | 622,269.43 | 2.72 |
| 46 | 300203 | 聚光科技   | 615,758.33 | 2.69 |
| 47 | 002129 | TCL 中环 | 614,737.00 | 2.68 |
| 48 | 688333 | 铂力特    | 610,484.60 | 2.67 |
| 49 | 601766 | 中国中车   | 608,867.00 | 2.66 |
| 50 | 601668 | 中国建筑   | 600,795.00 | 2.62 |
| 51 | 601899 | 紫金矿业   | 600,673.00 | 2.62 |
| 52 | 688232 | 新点软件   | 599,869.17 | 2.62 |
| 53 | 601989 | 中国重工   | 599,457.00 | 2.62 |
| 54 | 600809 | 山西汾酒   | 596,254.00 | 2.60 |
| 55 | 600941 | 中国移动   | 596,024.00 | 2.60 |
| 56 | 688315 | 诺禾致源   | 592,795.19 | 2.59 |
| 57 | 688372 | 伟测科技   | 591,200.67 | 2.58 |
| 58 | 601658 | 邮储银行   | 590,606.00 | 2.58 |
| 59 | 688326 | 经纬恒润   | 587,809.49 | 2.57 |
| 60 | 688023 | 安恒信息   | 587,006.87 | 2.56 |
| 61 | 002453 | 华软科技   | 586,935.00 | 2.56 |
| 62 | 000338 | 潍柴动力   | 582,530.00 | 2.54 |
| 63 | 688800 | 瑞可达    | 581,452.22 | 2.54 |
| 64 | 600018 | 上港集团   | 570,616.00 | 2.49 |

|     |        |      |            |      |
|-----|--------|------|------------|------|
| 65  | 300122 | 智飞生物 | 569,615.67 | 2.49 |
| 66  | 688711 | 宏微科技 | 558,682.88 | 2.44 |
| 67  | 601918 | 新集能源 | 551,960.00 | 2.41 |
| 68  | 601816 | 京沪高铁 | 551,888.00 | 2.41 |
| 69  | 603806 | 福斯特  | 550,334.00 | 2.40 |
| 70  | 600219 | 南山铝业 | 545,006.00 | 2.38 |
| 71  | 600025 | 华能水电 | 544,558.00 | 2.38 |
| 72  | 601169 | 北京银行 | 543,808.00 | 2.37 |
| 73  | 603298 | 杭叉集团 | 534,352.08 | 2.33 |
| 74  | 300271 | 华宇软件 | 529,525.00 | 2.31 |
| 75  | 600971 | 恒源煤电 | 515,301.00 | 2.25 |
| 76  | 300767 | 震安科技 | 513,279.00 | 2.24 |
| 77  | 600989 | 宝丰能源 | 512,074.00 | 2.24 |
| 78  | 600276 | 恒瑞医药 | 506,866.00 | 2.21 |
| 79  | 600690 | 海尔智家 | 506,595.00 | 2.21 |
| 80  | 003012 | 东鹏控股 | 503,231.00 | 2.20 |
| 81  | 600266 | 城建发展 | 501,291.00 | 2.19 |
| 82  | 300750 | 宁德时代 | 499,810.00 | 2.18 |
| 83  | 688321 | 微芯生物 | 497,977.39 | 2.17 |
| 84  | 301239 | 普瑞眼科 | 497,659.00 | 2.17 |
| 85  | 603108 | 润达医疗 | 495,584.00 | 2.16 |
| 86  | 601688 | 华泰证券 | 494,712.00 | 2.16 |
| 87  | 688116 | 天奈科技 | 491,517.01 | 2.15 |
| 88  | 688981 | 中芯国际 | 485,941.14 | 2.12 |
| 89  | 000166 | 申万宏源 | 484,065.00 | 2.11 |
| 90  | 688556 | 高测股份 | 482,593.09 | 2.11 |
| 91  | 600547 | 山东黄金 | 480,348.00 | 2.10 |
| 92  | 688033 | 天宜上佳 | 480,230.87 | 2.10 |
| 93  | 688508 | 芯朋微  | 479,833.00 | 2.10 |
| 94  | 688239 | 航宇科技 | 479,146.01 | 2.09 |
| 95  | 600019 | 宝钢股份 | 478,254.00 | 2.09 |
| 96  | 000333 | 美的集团 | 477,611.00 | 2.09 |
| 97  | 688256 | 寒武纪  | 477,483.73 | 2.08 |
| 98  | 688356 | 键凯科技 | 476,230.13 | 2.08 |
| 99  | 688173 | 希荻微  | 473,976.07 | 2.07 |
| 100 | 002544 | 普天科技 | 465,768.00 | 2.03 |
| 101 | 301286 | 侨源股份 | 464,671.00 | 2.03 |
| 102 | 688091 | 上海谊众 | 461,373.89 | 2.01 |
| 103 | 002928 | 华夏航空 | 460,775.00 | 2.01 |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|----------|----------------|
|----|------|------|----------|----------------|

|    | 码      |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 1  | 300762 | 上海瀚讯   | 1,141,985.00 | 4.99 |
| 2  | 601398 | 工商银行   | 1,054,888.00 | 4.61 |
| 3  | 600406 | 国电南瑞   | 951,863.00   | 4.16 |
| 4  | 000100 | TCL 科技 | 935,953.00   | 4.09 |
| 5  | 688680 | 海优新材   | 909,586.28   | 3.97 |
| 6  | 601318 | 中国平安   | 903,488.00   | 3.95 |
| 7  | 601988 | 中国银行   | 873,153.00   | 3.81 |
| 8  | 688598 | 金博股份   | 869,497.69   | 3.80 |
| 9  | 688031 | 星环科技   | 835,633.11   | 3.65 |
| 10 | 688700 | 东威科技   | 827,259.93   | 3.61 |
| 11 | 601288 | 农业银行   | 823,795.00   | 3.60 |
| 12 | 600519 | 贵州茅台   | 822,937.00   | 3.59 |
| 13 | 300782 | 卓胜微    | 820,533.00   | 3.58 |
| 14 | 600900 | 长江电力   | 741,913.00   | 3.24 |
| 15 | 688392 | 骄成超声   | 739,586.21   | 3.23 |
| 16 | 601918 | 新集能源   | 732,370.00   | 3.20 |
| 17 | 601628 | 中国人寿   | 727,885.00   | 3.18 |
| 18 | 600887 | 伊利股份   | 726,838.00   | 3.17 |
| 19 | 601138 | 工业富联   | 719,016.00   | 3.14 |
| 20 | 688152 | 麒麟信安   | 714,452.96   | 3.12 |
| 21 | 600696 | 岩石股份   | 713,309.00   | 3.11 |
| 22 | 601728 | 中国电信   | 707,972.00   | 3.09 |
| 23 | 600919 | 江苏银行   | 694,286.00   | 3.03 |
| 24 | 601615 | 明阳智能   | 691,927.00   | 3.02 |
| 25 | 688733 | 壹石通    | 686,124.73   | 3.00 |
| 26 | 601766 | 中国中车   | 683,721.00   | 2.99 |
| 27 | 688166 | 博瑞医药   | 681,297.25   | 2.97 |
| 28 | 300760 | 迈瑞医疗   | 679,855.00   | 2.97 |
| 29 | 688131 | 皓元医药   | 669,554.03   | 2.92 |
| 30 | 688110 | 东芯股份   | 666,068.08   | 2.91 |
| 31 | 300203 | 聚光科技   | 665,098.00   | 2.90 |
| 32 | 601899 | 紫金矿业   | 659,323.00   | 2.88 |
| 33 | 688383 | 新益昌    | 658,168.59   | 2.87 |
| 34 | 688333 | 铂力特    | 652,309.73   | 2.85 |
| 35 | 601857 | 中国石油   | 649,632.00   | 2.84 |
| 36 | 603713 | 密尔克卫   | 643,058.00   | 2.81 |
| 37 | 601939 | 建设银行   | 642,753.00   | 2.81 |
| 38 | 000651 | 格力电器   | 637,835.00   | 2.79 |
| 39 | 688800 | 瑞可达    | 617,576.03   | 2.70 |
| 40 | 003012 | 东鹏控股   | 617,273.00   | 2.70 |
| 41 | 688238 | 和元生物   | 614,788.25   | 2.68 |
| 42 | 002129 | TCL 中环 | 614,657.00   | 2.68 |

|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 43 | 300973 | 立高食品  | 612,483.00 | 2.67 |
| 44 | 688133 | 泰坦科技  | 609,379.44 | 2.66 |
| 45 | 002812 | 恩捷股份  | 599,983.00 | 2.62 |
| 46 | 688326 | 经纬恒润  | 593,582.24 | 2.59 |
| 47 | 600028 | 中国石化  | 589,838.00 | 2.58 |
| 48 | 601658 | 邮储银行  | 589,354.00 | 2.57 |
| 49 | 002544 | 普天科技  | 587,959.00 | 2.57 |
| 50 | 300271 | 华宇软件  | 587,770.00 | 2.57 |
| 51 | 600971 | 恒源煤电  | 587,734.00 | 2.57 |
| 52 | 688372 | 伟测科技  | 567,014.89 | 2.48 |
| 53 | 688173 | 希荻微   | 562,574.09 | 2.46 |
| 54 | 600690 | 海尔智家  | 559,340.00 | 2.44 |
| 55 | 601319 | 中国人保  | 557,558.00 | 2.43 |
| 56 | 002415 | 海康威视  | 554,622.00 | 2.42 |
| 57 | 688711 | 宏微科技  | 553,163.47 | 2.42 |
| 58 | 603298 | 杭叉集团  | 542,108.80 | 2.37 |
| 59 | 688023 | 安恒信息  | 531,875.53 | 2.32 |
| 60 | 000426 | 兴业银锡  | 526,229.00 | 2.30 |
| 61 | 688007 | 光峰科技  | 519,601.89 | 2.27 |
| 62 | 600986 | 浙文互联  | 519,447.00 | 2.27 |
| 63 | 688499 | 利元亨   | 506,550.10 | 2.21 |
| 64 | 688256 | 寒武纪   | 505,086.03 | 2.21 |
| 65 | 002410 | 广联达   | 504,473.00 | 2.20 |
| 66 | 601688 | 华泰证券  | 503,292.00 | 2.20 |
| 67 | 601088 | 中国神华  | 502,610.00 | 2.19 |
| 68 | 601668 | 中国建筑  | 498,641.48 | 2.18 |
| 69 | 600219 | 南山铝业  | 498,573.00 | 2.18 |
| 70 | 300953 | 震裕科技  | 498,522.00 | 2.18 |
| 71 | 000895 | 双汇发展  | 498,349.00 | 2.18 |
| 72 | 601989 | 中国重工  | 495,134.00 | 2.16 |
| 73 | 300767 | 震安科技  | 491,009.00 | 2.14 |
| 74 | 688707 | 振华新材  | 490,741.45 | 2.14 |
| 75 | 000725 | 京东方 A | 490,681.00 | 2.14 |
| 76 | 002453 | 华软科技  | 488,421.00 | 2.13 |
| 77 | 601816 | 京沪高铁  | 487,989.00 | 2.13 |
| 78 | 603108 | 润达医疗  | 487,953.00 | 2.13 |
| 79 | 688232 | 新点软件  | 487,787.70 | 2.13 |
| 80 | 688116 | 天奈科技  | 483,991.66 | 2.11 |
| 81 | 600266 | 城建发展  | 481,897.00 | 2.10 |
| 82 | 301286 | 侨源股份  | 479,769.00 | 2.09 |
| 83 | 600018 | 上港集团  | 473,598.00 | 2.07 |
| 84 | 688315 | 诺禾致源  | 469,568.01 | 2.05 |
| 85 | 688556 | 高测股份  | 469,050.32 | 2.05 |



|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 86 | 300750 | 宁德时代 | 467,259.80 | 2.04 |
| 87 | 002928 | 华夏航空 | 466,792.00 | 2.04 |
| 88 | 600531 | 豫光金铅 | 466,748.00 | 2.04 |
| 89 | 000338 | 潍柴动力 | 466,133.00 | 2.04 |
| 90 | 600875 | 东方电气 | 464,969.00 | 2.03 |
| 91 | 601567 | 三星医疗 | 464,132.00 | 2.03 |
| 92 | 601001 | 晋控煤业 | 463,284.00 | 2.02 |
| 93 | 003816 | 中国广核 | 459,490.00 | 2.01 |
| 94 | 688278 | 特宝生物 | 458,149.24 | 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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 216,816,203.98 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 206,733,111.11 |

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 1,934,561.78 | 5.44         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 1,934,561.78 | 5.44         |

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019727 | 23 国债 24 | 19,000 | 1,934,561.78 | 5.44         |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 25,624,526.69 元，占基金资产净值的比例为 72.01%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 24,016,160.00 元，占基金资产净值的比例为 67.49%，空头合约市值占股票资产的比例为 93.72%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -237,942.05 元，公允价值变动损益为 -432,675.17 元。

## 7.13 投资组合报告附注

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

京东方科技集团股份有限公司

2024 年 6 月 9 日，京东方科技集团股份有限公司因未按期申报税款，被国家税务总局北京市朝阳区税务局第二税务所责令改正

上海银行股份有限公司

上海银行股份有限公司部分分行或支行在报告编制日前一年内存在多项违规行为，包括但不限于：无结售汇业务资质的分支机构违规办理结售汇业务；贷款“三查”不尽职；信贷资金违规流入限制性领域；代销业务管理不到位；票据业务管理不审慎；员工行为管理不到位；已批准停止营业的分支机构违规办理结售汇业务；违规向境外个人销售外币理财产品；违规办理内保外贷业务；违规办理备用金结汇；未按规定报送结售汇统计数据；虚增银行间外汇市场交易量；使用未经授权的通讯工具开展银行间外汇市场交易以及未按规定保存银行间外汇市场交易记录；未按规定披露理财产品的杠杆水平；开展理财业务违反公平交易原则；理财业务数据登记错误；产品

日期、流动性、市值等违规；贷款管理严重不审慎；违规向委托贷款借款人收取手续费；存贷挂钩；信贷管理不尽职；表外业务贸易背景审查不严；未按规定提供报表；未根据标的项目的实际进度和资金需求发放贷款。被国家外汇管理局、中国银行保险监督管理委员会、国家金融监督管理总局等监管机构及上述机构的派出机构处罚。

#### 中国工商银行股份有限公司

中国工商银行股份有限公司部分分行或支行在报告编制日前一年内存在多项违规行为，包括但不限于：贷款业务严重违反审慎经营规则；信用卡汽车分期付款业务严重违反审慎经营规则、与无融资担保资质机构合作开展业务、对其分支机构信用卡汽车分期业务管控不力承担管理责任；服务收费质价不符；未严格审核银行承兑汇票业务贸易背景；借贷捆绑保险产品；未按规定实施绩效薪酬延期支付；办理经常项目收汇业务未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违规延期清算；支行客户经理存在违规发放贷款行为；贷后管理不到位，信贷资金违规流入限制性领域、证券市场；流动资金贷款未按约定用途使用；员工参与民间融资；信用卡汽车专项分期贷后管理不到位；内控管理失效；内控制度存在漏洞，员工行为管理不到位；存在瞒报案件信息的行为；违反外汇登记管理规定；违反规定办理结汇；员工行为管理不到位，发生员工职务侵占；未按规定向监管部门报送案件信息；未制作并向投保人出示客户告知书、未按规定建立保险代理业务档案、未按规定对从业人员进行执业管理；违反中国人民银行行政许可管理规定；违反规定办理收结汇业务；贷款“三查”不尽职、导致形成风险，未发现借款人按揭首付款未实际缴付；违规收取贷款承诺费；贴现资金回流至出票人账户；流动资金贷款回流至借款人；个人贷款违规流入房地产、基金公司；未按规定报送支行降格事项；违反人民币收付管理相关规定；对外支付污损人民币现金；质价不符；因管理不善导致金融许可证遗失；迟报案件确认报告；管理失职，致使下级支行发生客户经理诈骗、盗窃客户资金案件；房地产业务管理不审慎；小微企业划型不准确；内控管理不到位，导致部分分支机构对总行收费减免优惠措施执行不到位；违规销售代理保险；个人住房按揭贷款贷前调查未尽职；发放房地产开发贷款时未尽职调查核实工程进度；违规收取贷款承诺费；案防工作不尽职，对员工异常行为排查不到位；流动资金贷款调查不尽职，贷款资金被挪用；未通过保险中介信息系统如实报告实际代理保险相关情况行为、存在代理保险相关档案管理不到位行为；贷款管理不到位、违规收费；个人住房贷款业务违反审慎经营规则；违法违规发放贷款；收取贷款承诺费而未提供实质服务，内部控制不到位；未严格区分中间业务收入和贷款利息收入，将利息分解为费用收取，严重违反审慎经营规则；个人贷款部分违规流入股市；对员工在本行办理个人信用贷款管控不到位；对服务收费会计记载不规范、对第三方机构人员在本行网点开展客户服务、推介活动管控不到位、对辖内机构网点绩效考核管理

不到位，严重违反审慎经营规则；违规发放房地产贷款、贷后管理不到位导致贷款资金被挪用于缴纳土地出让金；利用本行信贷资金为本行理财产品提供融资、发放贷款偿还欠息掩盖资产质量、业务存续期管理不到位导致贷款或理财资金被挪用；项目资本金管理不到位，未与贷款配套使用，严重违反审慎经营规则；开立个人银行结算账户超期限备案；贷款承诺费收费定价测算不规范；未严格审核资本金来源的合规性和应付工程款的真实性，违规发放房地产开发贷款；发放固定资产贷款未严格审核股东借款真实性。被中国银行保险监督管理委员会、国家金融监督管理总局、国家外汇管理局等监管机构及上述机构的派出机构处罚。

#### 北京银行股份有限公司

北京银行股份有限公司部分分行或支行在报告编制日前一年内存在多项违规行为，包括但不限于：未按规定报送账户开立、撤销资料；办理货币收付、清分业务人员不具备专业能力判断和挑剔假币；占压财政存款或资金；未履行客户身份识别义务；未报送大额交易报告或可疑交易报告；未建立金融消费者权益保护专职部门或指定牵头部门；未建立消费者金融信息使用管理制度；漏报投诉数据；未落实合同面签制度；贷款“三查”不到位，信贷资金被挪用；结构性存款销售不规范；代理保险销售不规范；小微企业划型不准确；收费政策执行及整改不到位；房地产类业务违规；地方政府融资管理不审慎；贷款及投资业务管理不到位；关联交易管理及关联方名单管理不到位；内控管理不到位；资产分类不真实；贷款及同业投资“三查”严重不审慎；流动资金贷款管理不到位；向不具有借款资质的借款人发放贷款；信用卡资金管理不审慎；理财业务不合规；表外业务不合规；存款及柜面业务管理不到位；票据业务管理不到位；对信用证业务贸易背景审查不到位；员工与客户发生非正常资金往来；金融许可证遗失；房地产业务管理不审慎；EAST系统数据漏报、数据错报及不一致；对监管通报问题整改不到位。被中国银行保险监督管理委员会、国家金融监督管理总局、中国人民银行等监管机构及上述机构的派出机构处罚。

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。

### 7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选库之外的股票。

### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 2,900,700.22 |
| 2  | 应收清算款 | 285,519.41   |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 31.83        |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 3,186,251.46 |

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 持有人户数<br>(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<br>(%) | 持有份额          | 占总份额比例<br>(%) |
| 德邦量化对冲混合 A | 272          | 60,550.37 | 10,217,097.08 | 62.04         | 6,252,602.45  | 37.96         |
| 德邦量化对冲混合 C | 3,504        | 6,506.88  | 16,475,576.31 | 72.26         | 6,324,527.51  | 27.74         |
| 合计         | 3,776        | 10,399.84 | 26,692,673.39 | 67.97         | 12,577,129.96 | 32.03         |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 德邦量化对冲混合 A | 200,922.05 | 1.2199       |
|                  | 德邦量化对冲混合 C | 26,049.45  | 0.1143       |
|                  | 合计         | 226,971.50 | 0.5780       |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数       | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|------------------|--------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,217,097.08 | 26.02            | 9,999,200.00 | 25.46            | 3 年        |
| 基金管理人高级管理人员 | 208,330.27    | 0.53             | -            | -                | -          |
| 基金经理等人员     | -             | -                | -            | -                | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -                | -            | -                | -          |
| 其他          | -             | -                | -            | -                | -          |
| 合计          | 10,425,427.35 | 26.55            | 9,999,200.00 | 25.46            | -          |

注：本基金的发起份额承诺持有期限已满 3 年。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 德邦量化对冲混合 A     | 德邦量化对冲混合 C    |
|--|----------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2020 年 4 月 29 日)<br>基金份额总额 | 134,483,456.24 | 57,473,082.79 |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 17,699,185.37  | 7,425,764.26  |
| 本报告期基金总申购份额                            | 172,226.03     | 64,635,594.85 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | 1,401,711.87   | 49,261,255.29 |

|              |               |               |
|--------------|---------------|---------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | -             | -             |
| 本报告期期末基金份额总额 | 16,469,699.53 | 22,800,103.82 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，莫秋琴女士不再担任基金管理人副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称     | 交易单元数量 | 股票交易           |                  | 应支付该券商的佣金  |                | 备注 |
|----------|--------|----------------|------------------|------------|----------------|----|
|          |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 长江证券     | 2      | 423,549,315.09 | 100.00           | 146,503.45 | 100.00         | -  |
| 德邦证券     | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 东方证券     | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 国金证券     | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 国投证券     | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 天风证券     | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 野村东方国际证券 | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 银河证券     | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 招商证券     | 1      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 中信建投证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |
| 中银国际证券   | 2      | -              | -                | -          | -              | -  |

注：1、公司选择基金专用交易席位的基本选择标准：

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

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

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

2、本报告期内，本基金新增野村东方国际证券的交易单元；减少东方证券的交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元



| 券商名称     | 债券交易         |                 | 债券回购交易        |                   | 权证交易 |                 |
|----------|--------------|-----------------|---------------|-------------------|------|-----------------|
|          | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额          | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 长江证券     | 1,941,767.39 | 100.00          | 12,000,000.00 | 100.00            | -    | -               |
| 德邦证券     | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 东方证券     | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 国金证券     | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 国投证券     | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 天风证券     | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 野村东方国际证券 | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 银河证券     | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 招商证券     | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 中信建投证券   | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 中银国际证券   | -            | -               | -             | -                 | -    | -               |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                  | 法定披露方式                | 法定披露日期          |
|----|---------------------------------------|-----------------------|-----------------|
| 1  | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 1 月 16 日 |
| 2  | 德邦基金管理有限公司关于办公地址变更的公告                 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 1 月 23 日 |
| 3  | 德邦基金管理有限公司关于投资者业务申请因非交易日影响延后确认的提示性公告  | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 2 月 8 日  |
| 4  | 德邦基金管理有限公司关于变更股权结构的公告                 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 2 月 9 日  |
| 5  | 关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金可能触发基金      | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网  | 2024 年 3 月 1 日  |

|    |  |                       |                 |
|----|--|-----------------------|-----------------|
|    | 合同终止情形的提示性公告                                       | 站                     |                 |
| 6  | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 C 类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 3 月 1 日  |
| 7  | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2024 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 | 2024 年 3 月 1 日  |
| 8  | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 A 类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 3 月 1 日  |
| 9  | 关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金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 | 2024 年 3 月 15 日 |
| 10 | 关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金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 | 2024 年 3 月 22 日 |
| 11 | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 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 | 2024 年 3 月 30 日 |
| 12 | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 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 | 2024 年 4 月 19 日 |
| 13 | 关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金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 | 2024 年 5 月 17 日 |
| 14 | 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 | 2024 年 5 月 21 日 |
| 15 | 德邦基金管理有限公司关于董事变更的公告                                | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 5 月 28 日 |
| 16 | 关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金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 | 2024 年 5 月 31 日 |
| 17 | 关于德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金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 | 2024 年 6 月 7 日  |
| 18 | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 C 类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 6 月 28 日 |
| 19 | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金（德邦量化对冲混合 A 类份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2024 年 6 月 28 日 |
| 20 | 德邦量化对冲策略灵活配置混合型发                                   | 中国证监会基金电子披            | 2024 年 6 月 28 日 |

|    |                                    |                               |                 |
|----|------------------------------------|-------------------------------|-----------------|
|    | 起式证券投资基金更新招募说明书<br>(2024 年第 2 号)   | 露网站及基金管理人网<br>站               |                 |
| 21 | 德邦基金管理有限公司关于基金经理<br>揭诗琪女士暂停履行职务的公告 | 中国证监会基金电子披<br>露网站及基金管理人网<br>站 | 2024 年 6 月 29 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者<br>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<br>比例达到或者<br>超过 20%的时<br>间区间 | 期初<br>份额          | 申购<br>份额          | 赎回<br>份额          | 持有份额          | 份额<br>占比<br>(%) |
| 机构        | 1              | 20240101<br>- 20240630              | 10,217,09<br>7.08 | 16,474,4<br>64.58 | -                 | 26,691,561.66 | 67.97<br>00     |
|           | 2              | 20240103<br>- 20240109              | -                 | 14,277,8<br>69.30 | 14,277,86<br>9.30 | -             | -               |
|           | 3              | 20240321<br>- 20240327              | -                 | 15,307,2<br>38.14 | 15,307,23<br>8.14 | -             | -               |
|           | 4              | 20240613<br>- 20240613              | -                 | 17,742,2<br>93.19 | 17,742,29<br>3.19 | -             | -               |

#### 产品特有风险

- 1、本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；
- 4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- 5、单一投资者赎回后，若本基金连续 50 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，本基金将按照基金合同的约定，进入清算程序并终止，而无需召开基金份额持有人大会审议，其他投资者可能面临基金提前终止的风险；
- 6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- 7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、德邦量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内按照规定披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

上海市杨浦区荆州路 198 号万硕大厦 A 栋 25 楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件，亦可通过公司网站查询，公司网址为 [www.dbfund.com.cn](http://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 8 月 29 日