

德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF） 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：国泰君安证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰君安证券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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	12
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
§ 5 托管人报告	12
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
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	53
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	54

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）	
基金简称	德邦量化优选股票（LOF）	
基金主代码	167702	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2017 年 3 月 24 日	
基金管理人	德邦基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	56,112,462.90 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
下属分级基金的场内简称	量化优选	优选 C
下属分级基金的交易代码	167702	167703
报告期末下属分级基金的份额总额	21,508,180.85 份	34,604,282.05 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
本期已实现收益	-7,907,963.30	-12,474,182.00
本期利润	-7,524,433.01	-13,355,381.68
加权平均基金份 额本期利润	-0.3105	-0.3204
本期加权平均净 值利润率	-29.08%	-30.71%
本期基金份额净 值增长率	-22.13%	-22.23%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-572,710.64	-1,865,148.85
期末可供分配基	-0.0266	-0.0539

金份额利润		
期末基金资产净值	20,935,470.21	32,739,133.20
期末基金份额净值	0.9734	0.9461
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	11.00%	8.14%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦量化优选股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-10.02%	1.64%	-3.14%	0.46%	-6.88%	1.18%
过去三个月	-11.15%	2.08%	-2.03%	0.72%	-9.12%	1.36%
过去六个月	-22.13%	2.69%	0.88%	0.85%	-23.01%	1.84%
过去一年	-24.72%	1.98%	-9.38%	0.83%	-15.34%	1.15%
过去三年	-42.28%	1.52%	-32.19%	0.99%	-10.09%	0.53%
自基金合同生效起至今	11.00%	1.33%	0.70%	1.11%	10.30%	0.22%

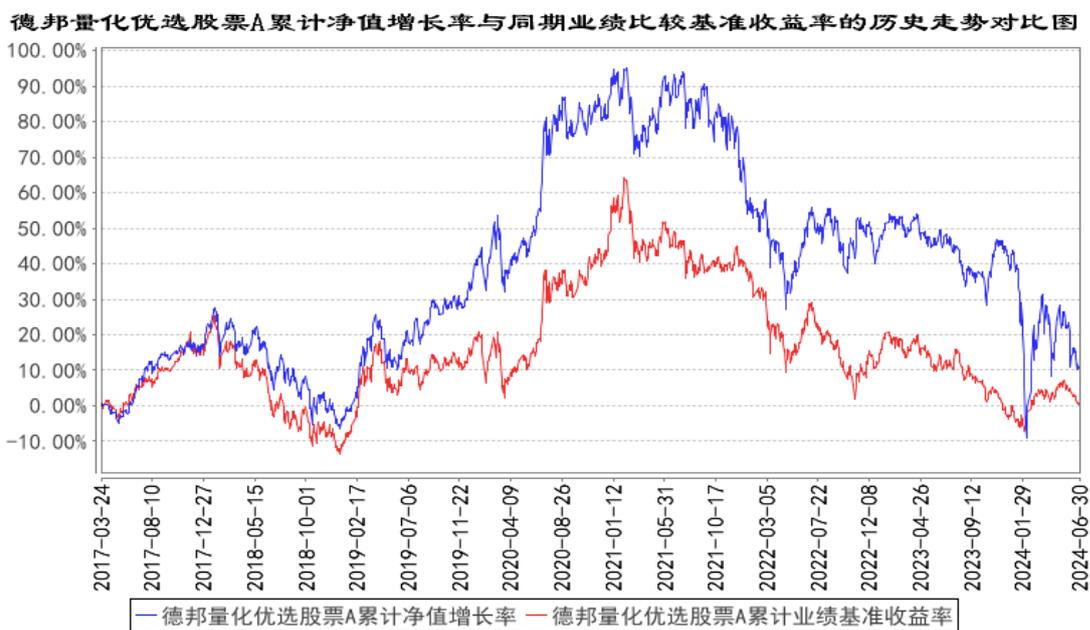
德邦量化优选股票 C

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

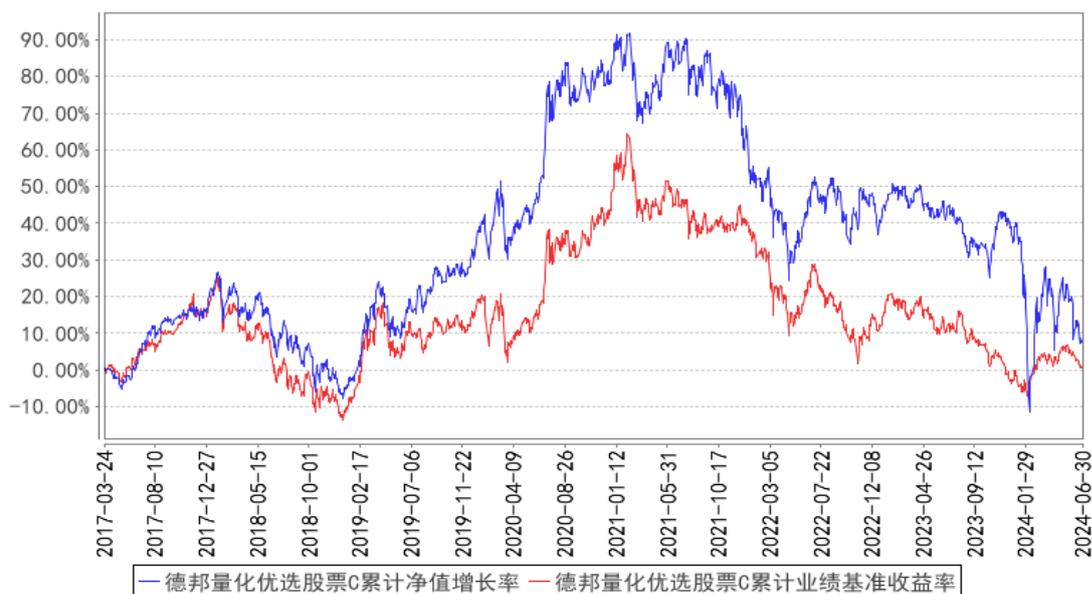
	率①	准差②		④		
过去一个月	-10.04%	1.64%	-3.14%	0.46%	-6.90%	1.18%
过去三个月	-11.21%	2.08%	-2.03%	0.72%	-9.18%	1.36%
过去六个月	-22.23%	2.69%	0.88%	0.85%	-23.11%	1.84%
过去一年	-24.92%	1.98%	-9.38%	0.83%	-15.54%	1.15%
过去三年	-42.72%	1.52%	-32.19%	0.99%	-10.53%	0.53%
自基金合同生效起至今	8.14%	1.33%	0.70%	1.11%	7.44%	0.22%

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

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



德邦量化优选股票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 2017 年 03 月 24 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年。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 2017 年 03 月 24 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 年上半年中国股市的情况总体呈现出震荡的走势。在经历了一轮深度调整后，股市出现了底部回升的迹象。然而，市场整体表现分化，大盘股相对表现较好，而成长及小盘股则出现调整。市场情绪修复和经济表现超预期对股市产生了一定的提振作用。

在投资管理上，本基金在全市场范围内结合海量因子驱动的人工智能模型、以基本面为驱动的多因子选股模型，把握优质个股的投资机会，积极获取超额收益率。在力求严格控制投资风险的前提下，通过数量化的方法进行积极的投资组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末德邦量化优选股票 A 基金份额净值为 0.9734 元，基金份额净值增长率为 -22.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%；德邦量化优选股票 C 基金份额净值为 0.9461 元，基金份额净值增长率为 -22.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年下半年，全球经济和市场将面临多重挑战和机遇。投资者需要密切关注宏观经济形势和政策变化，灵活调整投资策略，以应对市场波动和不确定性。

1. 宏观经济展望：2024 年下半年，宏观经济的“变”与“不变”中，政策选择和经济走向可能成为地缘政治等高维变量的结果。国内经济上半年延续回升向好态势，但需注意外部环境的潜在变化，特别是海外民族主义兴起和地缘冲突对外贸环境的影响。房地产和地方债务等短期政策选择可能发生变化，但发展新质生产力和全面深化改革的大方向不变。上半年经济结构不均衡，主要体现在新旧动能分化、供需不平衡以及居民恢复不稳固等方面。

2. 证券市场展望：随着政策、价格、外部三类信号逐步验证，证券市场可能迎来结构性变化，随着政策信号的明确和市场预期的修复，预计市场将逐步转向现实验证驱动的行市。

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,728,180.06	1,032,526.68
结算备付金		108,318.88	107,688.93
存出保证金		-	5,664,421.19
交易性金融资产	6.4.7.2	52,071,889.18	99,752,024.74
其中：股票投资		48,533,585.81	99,752,024.74
基金投资		-	-
债券投资		3,538,303.37	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		72,876.29	4,710,859.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	194.44
资产总计		53,981,264.41	111,267,715.24
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		47,505.46	826,578.05
应付管理人报酬		47,897.88	74,817.77
应付托管费		9,579.55	14,963.56
应付销售服务费		7,461.61	12,275.46
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	194,216.50	256,289.02
负债合计		306,661.00	1,184,923.86
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	56,112,462.90	89,734,682.85
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-2,437,859.49	20,348,108.53
净资产合计		53,674,603.41	110,082,791.38
负债和净资产总计		53,981,264.41	111,267,715.24

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，德邦量化优选股票 A 基金份额净值 0.9734 元，基金份额总额 21,508,180.85 份；德邦量化优选股票 C 基金份额净值 0.9461 元，基金份额总额 34,604,282.05 份。德邦量化优选股票（LOF）份额总额合计 56,112,462.90 份。

6.2 利润表

会计主体：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：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	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
一、营业总收入		-20,337,294.12	3,424,651.40
1. 利息收入		14,453.62	40,919.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	14,453.62	40,919.50
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,031,382.50	2,096,957.28
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-20,436,072.48	1,523,751.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	11,658.38	30.88
资产支持证券投资 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	-	-
股利收益	6.4.7.19	393,031.60	573,174.49
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-497,669.39	1,165,121.22
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	177,304.15	121,653.40
减：二、营业总支出		542,520.57	585,922.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	341,939.09	372,846.80
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	68,387.83	74,569.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	53,576.83	55,581.61
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		-	0.13
8. 其他费用	6.4.7.23	78,616.82	82,924.36
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-20,879,814.69	2,838,729.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-20,879,814.69	2,838,729.15
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-20,879,814.69	2,838,729.15

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	89,734,682.85	-	20,348,108.53	110,082,791.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	89,734,682.85	-	20,348,108.53	110,082,791.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-33,622,219.95	-	-22,785,968.02	-56,408,187.97
（一）、综合收益总额	-	-	-20,879,814.69	-20,879,814.69
（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）	-33,622,219.95	-	-1,906,153.33	-35,528,373.28
其中：1. 基金申购款	42,355,122.86	-	3,489,221.51	45,844,344.37
2. 基金赎回款	-75,977,342.81	-	-5,395,374.84	-81,372,717.65
（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	56,112,462.90	-	-2,437,859.49	53,674,603.41
项目	上年度可比期间 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	71,152,369.31	-	17,000,275.43	88,152,644.74

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	71,152,369.31	-	17,000,275.43	88,152,644.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,538,034.50	-	-145,386.65	-9,683,421.15
（一）、综合收益总额	-	-	2,838,729.15	2,838,729.15
（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）	-9,538,034.50	-	-2,984,115.80	-12,522,150.30
其中：1. 基金申购款	37,711,707.87	-	11,122,166.07	48,833,873.94
2. 基金赎回款	-47,249,742.37	-	-14,106,281.87	-61,356,024.24
（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	61,614,334.81	-	16,854,888.78	78,469,223.59

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

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

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

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+5\% \times$ 银行活期存款利率（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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,728,180.06
等于：本金	1,727,617.71
加：应计利息	562.35
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	1,728,180.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	48,849,743.46	-	48,533,585.81	-316,157.65	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,517,314.59	30,233.37	3,538,303.37	-9,244.59
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,517,314.59	30,233.37	3,538,303.37	-9,244.59
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	52,367,058.05	30,233.37	52,071,889.18	-325,402.24

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	99.68
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付信息披露费	159,781.56
应付审计费	29,835.26
应付账户维护费	4,500.00
合计	194,216.50

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

德邦量化优选股票 A

项目	本期 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	27,295,334.63	27,295,334.63
本期申购	28,322,344.95	28,322,344.95
本期赎回（以“-”号填列）	-34,109,498.73	-34,109,498.73
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	21,508,180.85	21,508,180.85

德邦量化优选股票 C

项目	本期 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	62,439,348.22	62,439,348.22
本期申购	14,032,777.91	14,032,777.91
本期赎回（以“-”号填列）	-41,867,844.08	-41,867,844.08
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	34,604,282.05	34,604,282.05

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

德邦量化优选股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,461,956.48	-7,636,265.81	6,825,690.67
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,461,956.48	-7,636,265.81	6,825,690.67
本期利润	-7,907,963.30	383,530.29	-7,524,433.01
本期基金份额交易产生的变动数	-1,880,500.39	2,006,532.09	126,031.70
其中：基金申购款	10,747,484.46	-8,143,496.97	2,603,987.49
基金赎回款	-12,627,984.85	10,150,029.06	-2,477,955.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,673,492.79	-5,246,203.43	-572,710.64

德邦量化优选股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,636,421.55	-17,114,003.69	13,522,417.86
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	30,636,421.55	-17,114,003.69	13,522,417.86
本期利润	-12,474,182.00	-881,199.68	-13,355,381.68
本期基金份额交易产生的变动数	-11,747,710.75	9,715,525.72	-2,032,185.03
其中：基金申购款	4,738,742.11	-3,853,508.09	885,234.02
基金赎回款	-16,486,452.86	13,569,033.81	-2,917,419.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,414,528.80	-8,279,677.65	-1,865,148.85

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

活期存款利息收入	13,823.67
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	629.95
其他	-
合计	14,453.62

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 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	-20,436,072.48
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	-20,436,072.48

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	619,428,580.35
减：卖出股票成本总额	638,594,748.26
减：交易费用	1,269,904.57
买卖股票差价收入	-20,436,072.48

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	11,666.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7.87
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	11,658.38

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	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	7.87
买卖债券差价收入	-7.87

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

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

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	393,031.60
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	393,031.60

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	-497,669.39
股票投资	-488,424.80
债券投资	-9,244.59
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-497,669.39

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	177,304.15
合计	177,304.15

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	29,835.26
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	78,616.82

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、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安证券”）	基金托管人
德邦证券股份有限公司（“德邦证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 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	341,939.09	372,846.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	109,542.62	118,397.81
应支付基金管理人的净管理费	232,396.47	254,448.99

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

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 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	68,387.83	74,569.35

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

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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	本期
-------------	----

方名称	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		
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C	合计
德邦基金	-	22,357.89	22,357.89
德邦证券	-	236.96	236.96
国泰君安	-	5.11	5.11
合计	-	22,599.96	22,599.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C	合计
德邦基金	-	25,673.97	25,673.97
德邦证券	-	88.17	88.17
国泰君安	-	5.43	5.43
合计	-	25,767.57	25,767.57

注：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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	3,045,263.09	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	3,045,263.09	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	3,045,263.09	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	3,045,263.09	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.1091%	-

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

德邦量化优选股票 C

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 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	12,600,016.65	36.4117	32,871,260.12	52.6451

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 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
国泰君安	1,107,974.20	8,894.90	826,092.16	26,965.75

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

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

注：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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,538,303.37	-

合计	3,538,303.37	-
----	--------------	---

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

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末以及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	1,728,180.06	-	-	-	-	-	1,728,180.06
结算备付金	108,318.88	-	-	-	-	-	108,318.88
交易性金融资产	-	-3,538,303.37	-	-	-	48,533,585.81	52,071,889.18
应收申购款	-	-	-	-	-	72,876.29	72,876.29
资产总计	1,836,498.94	-3,538,303.37	-	-	-	48,606,462.10	53,981,264.41
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	47,505.46	47,505.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,897.88	47,897.88
应付托管费	-	-	-	-	-	9,579.55	9,579.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7,461.61	7,461.61
其他负债	-	-	-	-	-	194,216.50	194,216.50
负债总计	-	-	-	-	-	306,661.00	306,661.00
利率敏感度缺口	1,836,498.94	-3,538,303.37	-	-	-	48,299,801.10	53,674,603.41
上年度末 2023年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,032,526.68	-	-	-	-	-	1,032,526.68
结算备付金	107,688.93	-	-	-	-	-	107,688.93
存出保证金	5,664,421.19	-	-	-	-	-	5,664,421.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	99,752,024.74	99,752,024.74
应收申购款	-	-	-	-	-	4,710,859.26	4,710,859.26

其他资产	-	-	-	-	194.44	194.44
资产总计	6,804,636.80	-	-	-	-104,463,078.44	111,267,715.24
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	826,578.05	826,578.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	74,817.77	74,817.77
应付托管费	-	-	-	-	14,963.56	14,963.56
应付销售服务费	-	-	-	-	12,275.46	12,275.46
其他负债	-	-	-	-	256,289.02	256,289.02
负债总计	-	-	-	-	1,184,923.86	1,184,923.86
利率敏感度缺口	6,804,636.80	-	-	-	-103,278,154.58	110,082,791.38

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	-4,968.80	0.00
	市场利率下降 25 个基点	4,978.44	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的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。

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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	48,533,585.81	90.42	99,752,024.74	90.62
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,538,303.37	6.59	-	-
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	52,071,889.18	97.01	99,752,024.74	90.62

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

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%	565,891.50	795,578.08
	沪深 300 下降 1%	-565,891.50	-795,578.08

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	48,533,585.81	99,752,024.74
第二层次	3,538,303.37	-
第三层次	-	-
合计	52,071,889.18	99,752,024.74

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	48,533,585.81	89.91
	其中：股票	48,533,585.81	89.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,538,303.37	6.55
	其中：债券	3,538,303.37	6.55
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,836,498.94	3.40
8	其他各项资产	72,876.29	0.14
9	合计	53,981,264.41	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	283,437.00	0.53
B	采矿业	3,037,850.00	5.66
C	制造业	24,774,230.30	46.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,151,468.00	4.01
E	建筑业	848,966.00	1.58
F	批发和零售业	868,251.00	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	2,047,082.80	3.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,774,082.72	7.03
J	金融业	9,126,646.00	17.00
K	房地产业	414,393.00	0.77

L	租赁和商务服务业	348,038.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	229,509.99	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	243,978.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,262.00	0.01
Q	卫生和社会工作	294,839.00	0.55
R	文化、体育和娱乐业	75,992.00	0.14
S	综合	10,560.00	0.02
	合计	48,533,585.81	90.42

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	27,000	1,116,720.00	2.08
2	600519	贵州茅台	700	1,027,173.00	1.91
3	000333	美的集团	12,000	774,000.00	1.44
4	600900	长江电力	25,700	743,244.00	1.38
5	601398	工商银行	121,900	694,830.00	1.29
6	000725	京东方A	145,800	596,322.00	1.11
7	600941	中国移动	5,400	580,500.00	1.08
8	601728	中国电信	93,100	572,565.00	1.07
9	601857	中国石油	49,800	513,936.00	0.96
10	601989	中国重工	103,100	508,283.00	0.95
11	600887	伊利股份	18,800	485,792.00	0.91
12	601668	中国建筑	90,200	478,962.00	0.89
13	300750	宁德时代	2,600	468,078.00	0.87
14	601899	紫金矿业	25,500	448,035.00	0.83
15	000651	格力电器	11,400	447,108.00	0.83
16	601169	北京银行	75,300	439,752.00	0.82
17	601229	上海银行	58,300	423,258.00	0.79
18	601816	京沪高铁	73,300	393,621.00	0.73
19	000100	TCL 科技	90,700	391,824.00	0.73
20	601288	农业银行	89,700	391,092.00	0.73
21	600919	江苏银行	50,500	375,215.00	0.70
22	601601	中国太保	13,300	370,538.00	0.69
23	600015	华夏银行	55,800	357,120.00	0.67
24	600019	宝钢股份	50,700	337,155.00	0.63
25	600050	中国联通	71,300	335,110.00	0.62
26	000338	潍柴动力	20,300	329,672.00	0.61
27	600025	华能水电	30,400	327,712.00	0.61

28	688567	孚能科技	33,900	325,440.00	0.61
29	601939	建设银行	42,800	316,720.00	0.59
30	601319	中国人保	61,400	316,210.00	0.59
31	600028	中国石化	48,800	308,416.00	0.57
32	002065	东华软件	67,900	306,908.00	0.57
33	600901	江苏金租	60,200	304,010.00	0.57
34	300088	长信科技	64,000	300,800.00	0.56
35	601828	美凯龙	116,800	297,840.00	0.55
36	000166	申万宏源	68,600	295,666.00	0.55
37	688276	百克生物	10,400	295,048.00	0.55
38	600927	永安期货	26,400	294,360.00	0.55
39	601658	邮储银行	58,000	294,060.00	0.55
40	002415	海康威视	9,100	281,281.00	0.52
41	601009	南京银行	27,000	280,530.00	0.52
42	000895	双汇发展	11,700	278,109.00	0.52
43	600018	上港集团	47,700	275,706.00	0.51
44	300122	智飞生物	9,800	274,694.00	0.51
45	601988	中国银行	57,300	264,726.00	0.49
46	601077	渝农商行	50,600	254,012.00	0.47
47	688348	昱能科技	4,300	253,700.00	0.47
48	600809	山西汾酒	1,200	253,056.00	0.47
49	000568	泸州老窖	1,700	243,933.00	0.45
50	600309	万华化学	3,000	242,580.00	0.45
51	002266	浙富控股	84,100	234,639.00	0.44
52	603185	弘元绿能	13,200	225,588.00	0.42
53	601766	中国中车	30,000	225,300.00	0.42
54	600406	国电南瑞	8,900	222,144.00	0.41
55	000050	深天马 A	30,500	222,040.00	0.41
56	600104	上汽集团	16,000	221,760.00	0.41
57	688295	中复神鹰	10,900	221,270.00	0.41
58	688105	诺唯赞	10,999	220,089.99	0.41
59	000553	安道麦 A	48,400	219,736.00	0.41
60	601088	中国神华	4,900	217,413.00	0.41
61	600177	雅戈尔	30,500	217,160.00	0.40
62	600517	国网英大	49,700	215,201.00	0.40
63	300850	新强联	14,000	210,280.00	0.39
64	002153	石基信息	36,300	207,999.00	0.39
65	000800	一汽解放	26,100	204,363.00	0.38
66	600959	江苏有线	76,500	201,960.00	0.38
67	600481	双良节能	43,200	201,744.00	0.38
68	600820	隧道股份	30,200	197,206.00	0.37
69	600547	山东黄金	7,100	194,398.00	0.36
70	688981	中芯国际	4,200	193,620.00	0.36

71	601006	大秦铁路	26,900	192,604.00	0.36
72	600030	中信证券	10,500	191,415.00	0.36
73	000027	深圳能源	25,900	189,070.00	0.35
74	300296	利亚德	41,700	187,650.00	0.35
75	002714	牧原股份	4,300	187,480.00	0.35
76	600219	南山铝业	48,800	185,928.00	0.35
77	603345	安井食品	2,500	185,775.00	0.35
78	603156	养元饮品	8,500	180,795.00	0.34
79	000401	冀东水泥	44,500	180,670.00	0.34
80	600926	杭州银行	13,700	178,785.00	0.33
81	600707	彩虹股份	26,200	178,422.00	0.33
82	688538	和辉光电	89,700	177,606.00	0.33
83	601818	光大银行	55,200	174,984.00	0.33
84	688002	睿创微纳	6,160	172,295.20	0.32
85	600161	天坛生物	7,000	170,800.00	0.32
86	601628	中国人寿	5,500	170,775.00	0.32
87	601633	长城汽车	6,700	169,510.00	0.32
88	600588	用友网络	16,800	168,000.00	0.31
89	688516	奥特维	4,000	167,240.00	0.31
90	600399	抚顺特钢	29,200	164,396.00	0.31
91	601919	中远海控	10,600	164,194.00	0.31
92	600416	湘电股份	16,500	164,010.00	0.31
93	603517	绝味食品	10,600	163,240.00	0.30
94	601985	中国核电	15,000	159,900.00	0.30
95	300999	金龙鱼	5,800	158,630.00	0.30
96	000538	云南白药	3,100	158,565.00	0.30
97	600048	保利发展	18,000	157,680.00	0.29
98	600998	九州通	31,700	154,696.00	0.29
99	002410	广联达	15,500	148,490.00	0.28
100	002078	太阳纸业	10,600	147,870.00	0.28
101	000728	国元证券	24,300	147,258.00	0.27
102	601898	中煤能源	11,700	146,016.00	0.27
103	688819	天能股份	6,068	144,782.48	0.27
104	002152	广电运通	13,800	144,348.00	0.27
105	600997	开滦股份	20,900	143,374.00	0.27
106	601012	隆基绿能	10,200	143,004.00	0.27
107	002791	坚朗五金	5,500	142,285.00	0.27
108	600066	宇通客车	5,500	141,900.00	0.26
109	688153	唯捷创芯	3,800	140,600.00	0.26
110	000723	美锦能源	29,300	139,468.00	0.26
111	603501	韦尔股份	1,400	139,118.00	0.26
112	002466	天齐锂业	4,600	137,586.00	0.26
113	002241	歌尔股份	7,000	136,570.00	0.25

114	603305	旭升集团	12,800	135,168.00	0.25
115	601577	长沙银行	16,500	134,970.00	0.25
116	001203	大中矿业	13,900	133,579.00	0.25
117	603993	洛阳钼业	15,700	133,450.00	0.25
118	600233	圆通速递	8,500	133,025.00	0.25
119	000967	盈峰环境	31,200	131,976.00	0.25
120	600989	宝丰能源	7,600	131,708.00	0.25
121	688779	长远锂科	28,400	131,492.00	0.24
122	688220	翱捷科技	3,500	131,110.00	0.24
123	603056	德邦股份	10,000	131,000.00	0.24
124	000975	银泰黄金	7,900	128,691.00	0.24
125	601198	东兴证券	16,100	128,156.00	0.24
126	000825	太钢不锈	37,900	128,102.00	0.24
127	002371	北方华创	400	127,956.00	0.24
128	600566	济川药业	4,000	126,840.00	0.24
129	002399	海普瑞	14,500	125,715.00	0.23
130	600600	青岛啤酒	1,700	123,709.00	0.23
131	603806	福斯特	8,300	122,010.00	0.23
132	300861	美畅股份	6,300	121,905.00	0.23
133	000727	冠捷科技	58,900	121,334.00	0.23
134	601336	新华保险	4,000	120,120.00	0.22
135	600812	华北制药	28,600	117,832.00	0.22
136	002044	美年健康	31,100	117,558.00	0.22
137	000830	鲁西化工	10,100	117,059.00	0.22
138	001872	招商港口	6,000	115,500.00	0.22
139	002240	盛新锂能	8,400	112,728.00	0.21
140	601021	春秋航空	2,000	112,660.00	0.21
141	600741	华域汽车	6,800	111,384.00	0.21
142	601916	浙商银行	40,300	111,228.00	0.21
143	600967	内蒙一机	15,200	109,440.00	0.20
144	688187	时代电气	2,200	108,636.00	0.20
145	600023	浙能电力	15,000	106,650.00	0.20
146	601865	福莱特	5,300	106,530.00	0.20
147	603883	老百姓	5,800	106,488.00	0.20
148	600595	中孚实业	42,700	106,323.00	0.20
149	688055	龙腾光电	33,500	106,195.00	0.20
150	601225	陕西煤业	4,100	105,657.00	0.20
151	300080	易成新能	36,600	105,408.00	0.20
152	600745	闻泰科技	3,700	104,525.00	0.19
153	600535	天士力	8,200	103,156.00	0.19
154	600036	招商银行	3,000	102,570.00	0.19
155	300015	爱尔眼科	9,900	102,168.00	0.19
156	603233	大参林	7,100	101,530.00	0.19

157	002867	周大生	7,700	100,562.00	0.19
158	688172	燕东微	6,200	100,316.00	0.19
159	000028	国药一致	3,100	99,913.00	0.19
160	688475	萤石网络	2,900	98,919.00	0.18
161	601155	新城控股	11,100	98,457.00	0.18
162	601838	成都银行	6,400	97,216.00	0.18
163	002212	天融信	19,800	96,426.00	0.18
164	300383	光环新网	11,400	96,330.00	0.18
165	601607	上海医药	4,900	93,639.00	0.17
166	000921	海信家电	2,900	93,496.00	0.17
167	600886	国投电力	5,100	93,024.00	0.17
168	002385	大北农	24,100	92,785.00	0.17
169	603317	天味食品	8,100	92,421.00	0.17
170	600188	兖矿能源	4,000	90,920.00	0.17
171	002648	卫星化学	5,000	89,900.00	0.17
172	688728	格科微	7,400	89,614.00	0.17
173	603225	新凤鸣	5,700	88,863.00	0.17
174	688496	清越科技	9,600	88,704.00	0.17
175	600276	恒瑞医药	2,300	88,458.00	0.16
176	600674	川投能源	4,700	88,125.00	0.16
177	600801	华新水泥	6,400	88,000.00	0.16
178	600380	健康元	7,800	87,126.00	0.16
179	605499	东鹏饮料	400	86,300.00	0.16
180	600500	中化国际	24,600	85,854.00	0.16
181	600115	中国东航	21,400	85,814.00	0.16
182	000598	兴蓉环境	11,300	84,976.00	0.16
183	688772	珠海冠宇	5,700	84,930.00	0.16
184	002745	木林森	10,500	84,630.00	0.16
185	603728	鸣志电器	2,100	84,483.00	0.16
186	601868	中国能建	39,800	84,376.00	0.16
187	601600	中国铝业	11,000	83,930.00	0.16
188	603737	三棵树	2,300	83,421.00	0.16
189	600026	中远海能	5,300	82,733.00	0.15
190	600350	山东高速	9,300	82,305.00	0.15
191	688009	中国通号	13,700	82,200.00	0.15
192	000301	东方盛虹	10,300	82,091.00	0.15
193	601609	金田股份	14,400	81,504.00	0.15
194	000156	华数传媒	12,900	81,012.00	0.15
195	600062	华润双鹤	4,100	80,278.00	0.15
196	688521	芯原股份	3,000	80,250.00	0.15
197	003816	中国广核	17,300	80,099.00	0.15
198	600909	华安证券	18,900	79,569.00	0.15
199	600346	恒力石化	5,700	79,515.00	0.15

200	000039	中集集团	8,500	78,710.00	0.15
201	601568	北元集团	21,200	78,652.00	0.15
202	000513	丽珠集团	2,100	78,141.00	0.15
203	600482	中国动力	4,000	77,920.00	0.15
204	000937	冀中能源	11,500	77,050.00	0.14
205	600348	华阳股份	7,700	76,692.00	0.14
206	301090	华润材料	11,600	76,328.00	0.14
207	002498	汉缆股份	23,100	75,999.00	0.14
208	301035	润丰股份	1,700	75,718.00	0.14
209	688063	派能科技	1,900	75,449.00	0.14
210	002978	安宁股份	2,700	75,222.00	0.14
211	688519	南亚新材	2,900	74,153.00	0.14
212	600690	海尔智家	2,600	73,788.00	0.14
213	002603	以岭药业	4,800	73,584.00	0.14
214	000761	本钢板材	29,200	73,292.00	0.14
215	300363	博腾股份	6,100	72,895.00	0.14
216	000063	中兴通讯	2,600	72,722.00	0.14
217	688392	骄成超声	1,700	72,148.00	0.13
218	600808	马钢股份	35,400	71,508.00	0.13
219	300498	温氏股份	3,600	71,352.00	0.13
220	600308	华泰股份	22,400	70,336.00	0.13
221	688739	成大生物	2,900	70,296.00	0.13
222	600377	宁沪高速	5,500	69,300.00	0.13
223	600037	歌华有线	11,500	68,770.00	0.13
224	600845	宝信软件	2,100	67,053.00	0.12
225	600888	新疆众和	9,400	66,458.00	0.12
226	601997	贵阳银行	12,600	66,402.00	0.12
227	601233	桐昆股份	4,100	65,436.00	0.12
228	601360	三六零	8,500	65,280.00	0.12
229	000970	中科三环	8,500	65,025.00	0.12
230	001330	博纳影业	12,000	64,920.00	0.12
231	002390	信邦制药	19,600	64,876.00	0.12
232	601139	深圳燃气	9,700	64,796.00	0.12
233	601168	西部矿业	3,600	64,620.00	0.12
234	002516	旷达科技	17,700	64,428.00	0.12
235	300048	合康新能	13,800	63,894.00	0.12
236	000002	万 科 A	9,200	63,756.00	0.12
237	002475	立讯精密	1,600	62,896.00	0.12
238	601187	厦门银行	11,800	62,894.00	0.12
239	000030	富奥股份	12,700	62,357.00	0.12
240	688246	嘉和美康	3,057	62,240.52	0.12
241	000157	中联重科	8,000	61,440.00	0.11
242	688234	天岳先进	1,300	60,996.00	0.11

243	002461	珠江啤酒	8,200	60,844.00	0.11
244	601778	晶科科技	25,900	59,052.00	0.11
245	601636	旗滨集团	9,100	58,695.00	0.11
246	601666	平煤股份	5,200	58,240.00	0.11
247	601186	中国铁建	6,700	57,419.00	0.11
248	601058	赛轮轮胎	4,100	57,400.00	0.11
249	300253	卫宁健康	9,700	57,230.00	0.11
250	002311	海大集团	1,200	56,460.00	0.11
251	601166	兴业银行	3,200	56,384.00	0.11
252	600851	海欣股份	12,100	55,297.00	0.10
253	601877	正泰电器	2,900	55,274.00	0.10
254	300628	亿联网络	1,500	55,155.00	0.10
255	002438	江苏神通	5,100	55,131.00	0.10
256	601808	中海油服	3,200	55,040.00	0.10
257	600739	辽宁成大	6,500	54,405.00	0.10
258	002865	钧达股份	1,400	53,732.00	0.10
259	000408	藏格矿业	2,200	52,954.00	0.10
260	688303	大全能源	2,587	52,748.93	0.10
261	002252	上海莱士	6,700	52,394.00	0.10
262	002007	华兰生物	3,300	52,107.00	0.10
263	601958	金钼股份	5,000	52,050.00	0.10
264	688561	奇安信	2,200	51,964.00	0.10
265	601555	东吴证券	8,800	51,920.00	0.10
266	688177	百奥泰	2,449	51,722.88	0.10
267	300529	健帆生物	1,900	51,699.00	0.10
268	000563	陕国投 A	18,500	50,875.00	0.09
269	688425	铁建重工	13,800	50,784.00	0.09
270	000987	越秀资本	10,200	50,592.00	0.09
271	000983	山西焦煤	4,900	50,519.00	0.09
272	600299	安迪苏	5,200	50,440.00	0.09
273	600985	淮北矿业	3,000	50,220.00	0.09
274	688505	复旦张江	7,700	49,280.00	0.09
275	002945	华林证券	4,900	48,902.00	0.09
276	002387	维信诺	6,300	38,304.00	0.07
277	600008	首创环保	13,800	36,984.00	0.07
278	300168	万达信息	7,700	36,575.00	0.07
279	600269	赣粤高速	6,600	34,122.00	0.06
280	000016	深康佳 A	15,700	33,441.00	0.06
281	601908	京运通	13,100	33,143.00	0.06
282	300323	华灿光电	7,300	31,755.00	0.06
283	300432	富临精工	4,800	30,912.00	0.06
284	001236	弘业期货	4,200	29,862.00	0.06
285	002100	天康生物	4,300	29,799.00	0.06

286	000516	国际医学	6,200	29,016.00	0.05
287	688700	东威科技	1,100	28,831.00	0.05
288	600185	格力地产	6,500	27,625.00	0.05
289	000547	航天发展	4,700	27,542.00	0.05
290	002291	遥望科技	6,200	26,660.00	0.05
291	605296	神农集团	700	24,605.00	0.05
292	000061	农产品	5,000	24,300.00	0.05
293	600664	哈药股份	9,100	24,024.00	0.04
294	600267	海正药业	3,400	23,868.00	0.04
295	002219	新里程	12,800	23,808.00	0.04
296	600623	华谊集团	4,100	23,698.00	0.04
297	600420	国药现代	2,200	23,496.00	0.04
298	600908	无锡银行	4,400	23,408.00	0.04
299	688388	嘉元科技	2,400	23,400.00	0.04
300	601015	陕西黑猫	8,300	23,240.00	0.04
301	300257	开山股份	2,300	23,230.00	0.04
302	002265	建设工业	2,600	22,438.00	0.04
303	603408	建霖家居	1,700	22,423.00	0.04
304	688707	振华新材	2,293	22,333.82	0.04
305	002048	宁波华翔	1,700	21,998.00	0.04
306	000429	粤高速 A	2,100	21,861.00	0.04
307	301268	铭利达	1,400	21,770.00	0.04
308	688400	凌云光	1,300	21,684.00	0.04
309	000012	南玻 A	4,300	21,672.00	0.04
310	300379	东方通	2,600	21,008.00	0.04
311	688275	万润新能	700	20,594.00	0.04
312	002453	华软科技	4,700	20,163.00	0.04
313	301155	海力风电	500	20,115.00	0.04
314	002488	金固股份	4,500	19,755.00	0.04
315	688232	新点软件	1,000	19,720.00	0.04
316	600252	中恒集团	9,000	19,530.00	0.04
317	600106	重庆路桥	4,400	18,920.00	0.04
318	600410	华胜天成	4,700	18,189.00	0.03
319	603881	数据港	1,420	18,048.20	0.03
320	002249	大洋电机	3,800	17,974.00	0.03
321	000582	北部湾港	2,400	17,856.00	0.03
322	600179	安通控股	7,600	17,708.00	0.03
323	600740	山西焦化	4,500	17,640.00	0.03
324	603368	柳药集团	1,000	17,500.00	0.03
325	000503	国新健康	2,600	17,342.00	0.03
326	300451	创业慧康	5,000	17,300.00	0.03
327	002884	凌霄泵业	900	17,280.00	0.03
328	688110	东芯股份	900	17,163.00	0.03

329	600020	中原高速	4,800	16,992.00	0.03
330	688382	益方生物	2,339	16,910.97	0.03
331	603367	辰欣药业	1,200	16,728.00	0.03
332	000536	华映科技	8,200	16,564.00	0.03
333	301260	格力博	1,200	16,344.00	0.03
334	600035	楚天高速	3,800	16,302.00	0.03
335	603489	八方股份	600	16,188.00	0.03
336	600936	广西广电	7,700	15,554.00	0.03
337	600123	兰花科创	1,700	15,215.00	0.03
338	002434	万里扬	3,100	15,190.00	0.03
339	603766	隆鑫通用	2,200	14,916.00	0.03
340	600548	深高速	1,400	14,882.00	0.03
341	600841	动力新科	4,500	14,760.00	0.03
342	002818	富森美	1,200	14,712.00	0.03
343	601107	四川成渝	2,800	14,700.00	0.03
344	688660	电气风电	5,100	14,688.00	0.03
345	601512	中新集团	1,900	14,478.00	0.03
346	002203	海亮股份	1,800	14,364.00	0.03
347	600810	神马股份	2,300	14,260.00	0.03
348	301207	华兰疫苗	800	14,136.00	0.03
349	301239	普瑞眼科	400	14,132.00	0.03
350	002123	梦网科技	2,000	14,060.00	0.03
351	000685	中山公用	1,900	13,699.00	0.03
352	603112	华翔股份	1,300	13,663.00	0.03
353	605018	长华集团	1,500	13,590.00	0.03
354	603053	成都燃气	1,400	13,524.00	0.03
355	688108	赛诺医疗	1,500	13,410.00	0.02
356	000543	皖能电力	1,500	13,275.00	0.02
357	000550	江铃汽车	600	13,026.00	0.02
358	600320	振华重工	3,800	12,996.00	0.02
359	600403	大有能源	5,000	12,900.00	0.02
360	688007	光峰科技	800	12,880.00	0.02
361	601020	华钰矿业	1,000	12,800.00	0.02
362	000657	中钨高新	1,400	12,796.00	0.02
363	603871	嘉友国际	720	12,736.80	0.02
364	600100	同方股份	2,500	12,725.00	0.02
365	002701	奥瑞金	3,000	12,480.00	0.02
366	600376	首开股份	5,900	12,390.00	0.02
367	603733	仙鹤股份	700	12,306.00	0.02
368	688311	盟升电子	600	12,294.00	0.02
369	600409	三友化工	2,400	12,048.00	0.02
370	002061	浙江交科	3,300	12,045.00	0.02
371	688023	安恒信息	300	12,003.00	0.02

372	688033	天宜上佳	2,000	12,000.00	0.02
373	000600	建投能源	1,900	11,970.00	0.02
374	600105	永鼎股份	3,200	11,904.00	0.02
375	002541	鸿路钢构	700	11,879.00	0.02
376	002004	华邦健康	3,100	11,780.00	0.02
377	603033	三维股份	1,000	11,700.00	0.02
378	000950	重药控股	2,400	11,688.00	0.02
379	600578	京能电力	3,600	11,664.00	0.02
380	605507	国邦医药	700	11,655.00	0.02
381	603567	珍宝岛	1,100	11,583.00	0.02
382	000402	金融街	4,900	11,515.00	0.02
383	002110	三钢闽光	3,900	11,505.00	0.02
384	600728	佳都科技	3,100	11,501.00	0.02
385	301327	华宝新能	200	11,460.00	0.02
386	002585	双星新材	2,300	11,408.00	0.02
387	002583	海能达	2,800	11,396.00	0.02
388	300587	天铁股份	2,800	11,312.00	0.02
389	000927	中国铁物	4,700	11,186.00	0.02
390	603866	桃李面包	2,200	11,154.00	0.02
391	688433	华曙高科	531	11,076.66	0.02
392	603103	横店影视	800	11,072.00	0.02
393	601038	一拖股份	700	11,067.00	0.02
394	000544	中原环保	1,400	11,018.00	0.02
395	600172	黄河旋风	5,800	10,904.00	0.02
396	600098	广州发展	1,700	10,880.00	0.02
397	601212	白银有色	3,900	10,842.00	0.02
398	000069	华侨城 A	5,300	10,812.00	0.02
399	002664	信质集团	900	10,710.00	0.02
400	600391	航发科技	700	10,675.00	0.02
401	000029	深深房 A	1,000	10,630.00	0.02
402	601003	柳钢股份	4,200	10,626.00	0.02
403	000521	长虹美菱	1,400	10,612.00	0.02
404	000917	电广传媒	2,100	10,605.00	0.02
405	002396	星网锐捷	800	10,568.00	0.02
406	600673	东阳光	1,500	10,560.00	0.02
407	603708	家家悦	1,300	10,543.00	0.02
408	603337	杰克股份	400	10,528.00	0.02
409	002030	达安基因	2,100	10,500.00	0.02
410	000096	广聚能源	1,100	10,450.00	0.02
411	600461	洪城环境	900	10,422.00	0.02
412	688383	新益昌	200	10,422.00	0.02
413	605266	健之佳	400	10,380.00	0.02
414	601717	郑煤机	700	10,360.00	0.02

415	002440	闰土股份	1,900	10,317.00	0.02
416	601665	齐鲁银行	2,100	10,311.00	0.02
417	688147	微导纳米	400	9,960.00	0.02
418	300558	贝达药业	300	9,765.00	0.02
419	688362	甬矽电子	500	9,730.00	0.02
420	300779	惠城环保	200	9,680.00	0.02
421	301217	铜冠铜箔	1,000	9,600.00	0.02
422	601686	友发集团	1,900	9,557.00	0.02
423	600828	茂业商业	4,000	9,480.00	0.02
424	603516	淳中科技	300	9,471.00	0.02
425	300492	华图山鼎	100	9,420.00	0.02
426	601827	三峰环境	1,100	9,339.00	0.02
427	688510	航亚科技	500	9,205.00	0.02
428	605008	长鸿高科	700	9,170.00	0.02
429	600770	综艺股份	4,000	9,160.00	0.02
430	603108	润达医疗	600	9,084.00	0.02
431	002749	国光股份	600	9,024.00	0.02
432	688289	圣湘生物	500	8,790.00	0.02
433	002807	江阴银行	2,300	8,671.00	0.02
434	603358	华达科技	300	8,655.00	0.02
435	300791	仙乐健康	343	8,643.60	0.02
436	000810	创维数字	1,000	8,580.00	0.02
437	000869	张裕A	400	8,540.00	0.02
438	000703	恒逸石化	1,200	8,508.00	0.02
439	600508	上海能源	600	8,490.00	0.02
440	300973	立高食品	300	8,427.00	0.02
441	300212	易华录	500	8,415.00	0.02
442	002421	达实智能	3,600	8,388.00	0.02
443	600033	福建高速	2,500	8,375.00	0.02
444	601089	福元医药	600	8,310.00	0.02
445	000603	盛达资源	700	8,281.00	0.02
446	600017	日照港	3,100	8,277.00	0.02
447	688185	康希诺	200	8,218.00	0.02
448	002145	中核钛白	2,500	8,200.00	0.02
449	300134	大富科技	1,200	8,184.00	0.02
450	603997	继峰股份	800	8,184.00	0.02
451	002545	东方铁塔	1,200	8,172.00	0.02
452	603882	金域医学	300	8,157.00	0.02
453	002958	青农商行	3,000	8,040.00	0.01
454	300142	沃森生物	700	7,966.00	0.01
455	688161	威高骨科	400	7,928.00	0.01
456	300601	康泰生物	500	7,805.00	0.01
457	002109	兴化股份	2,400	7,728.00	0.01

458	688001	华兴源创	342	7,722.36	0.01
459	601718	际华集团	3,100	7,688.00	0.01
460	301219	腾远钴业	200	7,652.00	0.01
461	688100	威胜信息	200	7,630.00	0.01
462	002139	拓邦股份	700	7,434.00	0.01
463	002489	浙江永强	3,100	7,347.00	0.01
464	601777	力帆科技	1,900	7,296.00	0.01
465	300140	节能环境	1,200	7,164.00	0.01
466	603985	恒润股份	600	7,140.00	0.01
467	600641	万业企业	600	7,050.00	0.01
468	002376	新北洋	1,300	7,007.00	0.01
469	688239	航宇科技	200	6,960.00	0.01
470	600170	上海建工	3,200	6,880.00	0.01
471	003019	宸展光电	270	6,839.10	0.01
472	600610	中毅达	1,700	6,766.00	0.01
473	600713	南京医药	1,600	6,752.00	0.01
474	600874	创业环保	1,200	6,708.00	0.01
475	600637	东方明珠	1,100	6,688.00	0.01
476	002840	华统股份	400	6,636.00	0.01
477	688165	埃夫特	845	6,607.90	0.01
478	002354	天娱数科	2,200	6,578.00	0.01
479	688280	精进电动	1,600	6,512.00	0.01
480	600884	杉杉股份	800	6,496.00	0.01
481	600761	安徽合力	300	6,492.00	0.01
482	600273	嘉化能源	900	6,426.00	0.01
483	002539	云图控股	900	6,417.00	0.01
484	688322	奥比中光	240	6,410.40	0.01
485	300026	红日药业	2,100	6,405.00	0.01
486	002335	科华数据	300	6,339.00	0.01
487	600667	太极实业	1,100	6,281.00	0.01
488	603071	物产环能	500	6,265.00	0.01
489	603421	鼎信通讯	1,400	6,244.00	0.01
490	002602	世纪华通	1,800	6,174.00	0.01
491	002093	国脉科技	1,000	6,070.00	0.01
492	002839	张家港行	1,500	6,030.00	0.01
493	300737	科顺股份	1,400	6,020.00	0.01
494	688733	壹石通	400	5,980.00	0.01
495	300627	华测导航	200	5,970.00	0.01
496	605118	力鼎光电	400	5,956.00	0.01
497	000088	盐田港	1,300	5,889.00	0.01
498	301171	易点天下	400	5,880.00	0.01
499	000612	焦作万方	900	5,850.00	0.01
500	688432	有研硅	600	5,814.00	0.01

501	001267	汇绿生态	1,100	5,797.00	0.01
502	688088	虹软科技	200	5,772.00	0.01
503	001323	慕思股份	200	5,754.00	0.01
504	002491	通鼎互联	1,700	5,746.00	0.01
505	002948	青岛银行	1,700	5,729.00	0.01
506	688225	亚信安全	500	5,665.00	0.01
507	300085	银之杰	700	5,656.00	0.01
508	002283	天润工业	1,300	5,577.00	0.01
509	601519	大智慧	1,000	5,560.00	0.01
510	000930	中粮科技	1,100	5,533.00	0.01
511	600226	亨通股份	2,800	5,516.00	0.01
512	603983	丸美股份	200	5,506.00	0.01
513	002833	弘亚数控	300	5,472.00	0.01
514	000709	河钢股份	2,800	5,432.00	0.01
515	603181	皇马科技	600	5,394.00	0.01
516	603515	欧普照明	300	5,202.00	0.01
517	605183	确成股份	300	4,638.00	0.01
518	603355	莱克电气	200	4,320.00	0.01
519	605098	行动教育	100	4,262.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688260	昀冢科技	2,698,480.55	2.45
2	688121	卓然股份	2,497,138.08	2.27
3	600605	汇通能源	2,457,448.00	2.23
4	603009	北特科技	2,433,139.00	2.21
5	688659	元琛科技	2,366,866.47	2.15
6	300469	信息发展	2,207,481.00	2.01
7	688311	盟升电子	2,184,286.45	1.98
8	688365	光云科技	2,012,563.47	1.83
9	688577	浙海德曼	1,878,603.36	1.71
10	605068	明新旭腾	1,868,716.00	1.70
11	688108	赛诺医疗	1,847,033.55	1.68
12	300857	协创数据	1,839,500.00	1.67
13	688228	开普云	1,783,420.93	1.62
14	688070	纵横股份	1,776,832.45	1.61
15	000809	*ST 和展	1,736,409.00	1.58
16	300550	和仁科技	1,722,195.00	1.56
17	688319	欧林生物	1,711,143.62	1.55
18	600519	贵州茅台	1,671,233.00	1.52
19	688382	益方生物	1,625,515.07	1.48

20	688310	迈得医疗	1,613,706.71	1.47
----	--------	------	--------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603009	北特科技	2,778,384.00	2.52
2	600605	汇通能源	2,503,649.00	2.27
3	688121	卓然股份	2,445,484.17	2.22
4	688659	元琛科技	2,239,233.35	2.03
5	688311	盟升电子	2,216,737.89	2.01
6	300469	信息发展	2,184,938.00	1.98
7	688260	昀冢科技	2,075,955.62	1.89
8	688108	赛诺医疗	2,054,935.12	1.87
9	688365	光云科技	1,968,440.03	1.79
10	688228	开普云	1,922,153.86	1.75
11	688577	浙海德曼	1,917,562.49	1.74
12	300550	和仁科技	1,888,806.00	1.72
13	300857	协创数据	1,797,163.00	1.63
14	688312	燕麦科技	1,796,512.01	1.63
15	605068	明新旭腾	1,778,072.00	1.62
16	688319	欧林生物	1,722,074.87	1.56
17	688310	迈得医疗	1,684,237.64	1.53
18	002290	禾盛新材	1,676,769.00	1.52
19	688070	纵横股份	1,667,443.29	1.51
20	688186	广大特材	1,655,116.98	1.50

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	587,864,734.13
卖出股票收入（成交）总额	619,428,580.35

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	3,538,303.37	6.59
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	3,538,303.37	6.59

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	019733	24 国债 02	34,000	3,436,484.33	6.40
2	019727	23 国债 24	1,000	101,819.04	0.19

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

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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。

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。

中国石油天然气股份有限公司

2023 年 8 月 2 日，中国石油天然气股份有限公司因违反税收管理规定，被国家税务总局长沙市望城区税务局责令改正

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	72,876.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,876.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
德邦量化 优选股票 A	965	22,288.27	831,566.92	3.87	20,676,613.93	96.13
德邦量化 优选股票 C	1,123	30,814.14	12,600,016.65	36.41	22,004,265.40	63.59
合计	2,088	26,873.78	13,431,583.57	23.94	42,680,879.33	76.06

8.2 期末上市基金前十名持有人

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所 有从业 人员持 有本基 金	德邦量化优选股票 A	286,964.14	1.3342
	德邦量化优选股票 C	561,854.24	1.6237
	合计	848,818.38	1.5127

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和相关部门 负责人持有本开放式 基金	德邦量化优选股票 A	-
	德邦量化优选股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有 本开放式基金	德邦量化优选股票 A	10~50
	德邦量化优选股票 C	50~100
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	德邦量化优选股票 A	德邦量化优选股票 C
基金合同生效日 (2017年3月24日) 基金份额总额	86,793,545.80	114,236,860.64
本报告期期初基金份 额总额	27,295,334.63	62,439,348.22

本报告期基金总申购份额	28,322,344.95	14,032,777.91
减：本报告期基金总赎回份额	34,109,498.73	41,867,844.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	21,508,180.85	34,604,282.05

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，南翰仪同志任职国泰君安证券资产托管部副总经理(主持工作)。陈忠义同志任国泰君安证券公司副总裁，不再兼任资产托管部总经理职务。具体信息参见国泰君安证券资产托管与基金服务网站公告《关于国泰君安证券股份有限公司资产托管部负责人变更的公告》。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华林证券	2	1,207,293,314.48	100.00	882,752.09	100.00	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

2、基金管理人与证券经纪商不存在关联关系。

3、基金管理人根据监管规定选择具备证券经纪业务资格的证券公司，并签订证券经纪服务协议。

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 (%)
华林证券	3,517,314.59	100.00	-	-	-	-

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	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 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

		站	
5	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 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
6	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 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
7	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
8	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
9	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) 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 6 月 28 日
10	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) (德邦量化优选股票 A 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2024 年 6 月 28 日
11	德邦量化优选股票型证券投资基金 (LOF) (德邦量化优选股票 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
12	德邦基金管理有限公司关于基金经理揭诗琪女士暂停履行职务的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101 - 20240630	35,916,523.21	-	23,316,506.56	12,600,016.65	22.4500
产品特有风险							
<p>1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；</p> <p>4、单一机构投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面</p>							

临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，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、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金合同；
- 3、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金托管协议；
- 4、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内按照规定披露的各项公告。

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。

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