

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

编制日期：2024 年 6 月 3 日

送出日期：2024 年 6 月 28 日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	德邦量化优选股票（LOF）	基金代码	167702
下属基金简称	德邦量化优选股票 A	下属基金交易代码	167702
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
基金合同生效日	2017 年 3 月 24 日	上市交易所及上市日期	—
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	工作日开放
基金经理	李荣兴	开始担任本基金基金经理的日期	2022 年 6 月 17 日
		证券从业日期	2011 年 5 月 12 日

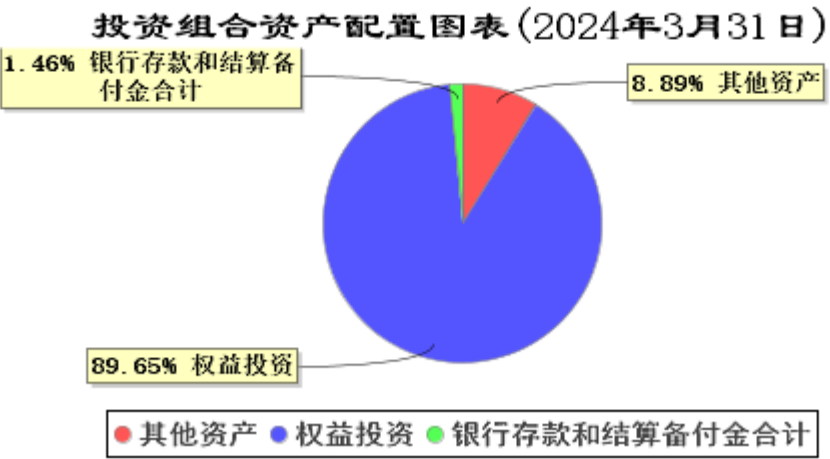
二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

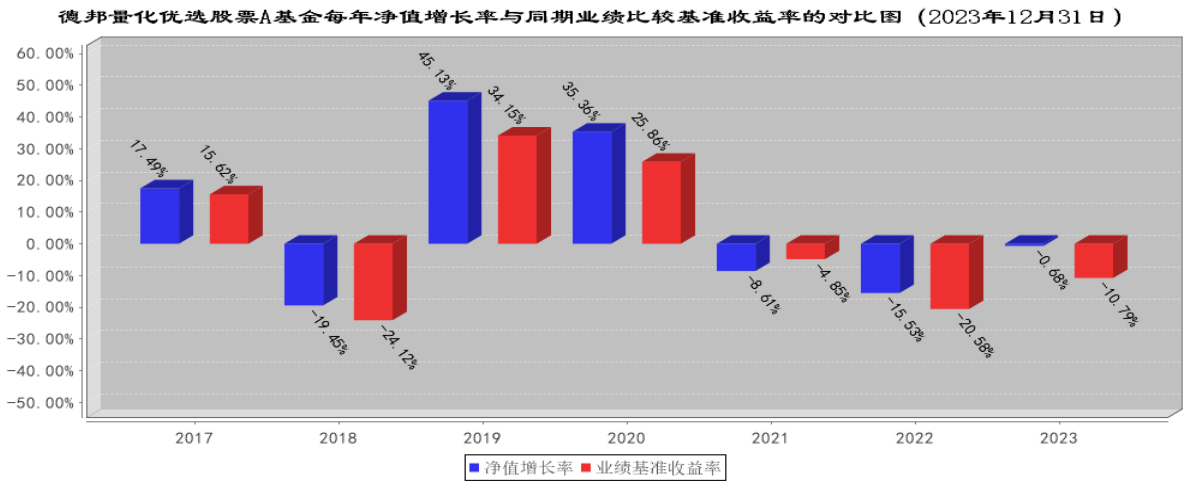
投资者可阅读《德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新中“第十部分 基金的投资”了解详细情况。

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。
投资范围	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）。
主要投资策略	本基金利用量化投资模型，在严格控制投资风险的前提下，力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。通过资股票投资策略、固定收益投资策略、衍生品投资策略、中小企业私募债券投资策略、资产支持证券的投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略等多方面进行全面分析，调整投资组合配置。
业绩比较基准	95%×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。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：1. 基金合同生效当年按实际期限计算，不按整个自然年度折算。
2. 基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额（S）或金额（M） /持有期限（N）	收费方式/费率		备注
申购费 （前收费）	M<500,000	—	1.2%	—
	500,000≤M<2,000,000	—	0.8%	—
	2,000,000≤M<5,000,000	—	0.4%	—
	M≥5,000,000	—	按笔收取，1000 元/笔	—
赎回费	N<7 日	—	1.5%	场外赎回费
	7 日≤N<1 年	—	0.5%	场外赎回费
	1 年≤N<2 年	—	0.25%	场外赎回费
	N≥2 年	—	0	场外赎回费

	N<7 日	-	1.5%	场内赎回费
	N≥7 日	-	0.5%	场内赎回费

申购费

场内会员单位应按照场外申购费率设定投资人场内申购的申购费用。

赎回费

本基金按照场外赎回费率设定投资人的场内赎回费率。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率或金额	收取方
管理费	1.00%	基金管理人和销售机构
托管费	0.20%	基金托管人
审计费用	60,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费，基金份额持有人大会费用，基金的证券、期货交易费用及因基金投资产生的费用等，基金的银行汇划费用，基金的账户开户及维护费用，按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。	

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

德邦量化优选股票 A

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.41%

注：基金管理人费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

四、风险揭示与重要提示**(一) 风险揭示**

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

(1) 本基金在控制组合跟踪误差的基础上力求获得超越业绩比较基准的投资收益，存在一定的跟踪偏离风险。此外，在运用量化策略投资的过程中，可能因模型误差等各种原因，其优选出的组合收益率不一定持续高于业绩比较基准的收益率，存在一定的风险。

(2) 中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。中小企业私募债的风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险，是中小企业私募债最大的风险。流动性风险是由于中小企业私募债交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实

际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

（3）股指期货投资风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货主要存在以下风险：

- 1）市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险；
- 2）流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险；
- 3）基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险；
- 4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险；
- 5）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险；
- 6）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

（4）国债期货投资风险

本基金可投资于国债期货，可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等

- 1）市场风险：是指因国债期货市场价格波动使所持有的国债期货合约价值发生变化的风险；
- 2）流动性风险：是指由于国债期货合约无法及时变现所带来的风险；
- 3）基差风险：是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险；
- 4）保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险；
- 5）信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险；
- 6）操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

（5）投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

（6）基金提前终止风险

基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，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。基金份额持有人可能面临基金提前终止风险。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确

获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.dbfund.com.cn][客服热线：021-36034888/400-821-7788（免长途电话费）]

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 3、基金份额净值
- 4、基金销售机构及联系方式
- 5、其他重要资料