

德邦优化配置股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告截止日期:2013年10月23日

基金概况
基金名称:德邦优化配置
基金代码:770001
基金运作方式:契约型、开放式
基金合同生效日:2012年9月24日
报告期末基金份额总额:76,554,113.23

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: -375,706.61
2.本期利润: -8,975,286.61
3.加权平均基金份额本期利润: 0.1140
4.期末基金资产净值: 90,332,330.98
5.期末基金份额净值: 1.1798

3.2 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 601318 中国平安 170,000 6,099,000.00 6.72



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明
白仲光 本基金的基金经理 2012年9月25日 - 10 2012年9月加入德邦基金管理有限公司

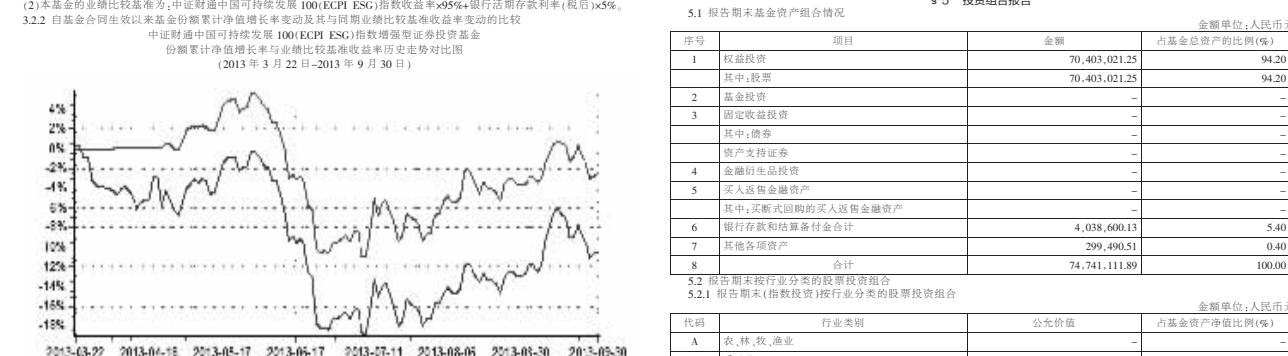
1.1 基金合同生效以来基金投资业绩与比较基准的比较
1.2 基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
1.3 基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金管理人:德邦基金管理有限公司
基金托管人:上海银行股份有限公司
报告截止日期:2013年10月23日

基金概况
基金名称:中证财通中国可持续发展100(ESPI ESG)指数增强型证券投资基金
基金代码:000042
基金运作方式:契约型、开放式
基金合同生效日:2013年03月22日
报告期末基金份额总额:76,122,133.20

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: -2,105,833.41
2.本期利润: -5,685,738.80
3.加权平均基金份额本期利润: 0.0720
4.期末基金资产净值: 74,221,261.30
5.期末基金份额净值: 0.9751

3.2 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 601318 中国平安 170,000 6,099,000.00 6.72



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
报告截止日期:2013年10月23日

基金概况
基金名称:德邦中证500指数增强型证券投资基金
基金代码:770002
基金运作方式:契约型、开放式
基金合同生效日:2013年03月22日
报告期末基金份额总额:76,122,133.20

德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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
报告截止日期:2013年10月23日

基金概况
基金名称:德邦德信中证中高收益企债指数分级
基金代码:167701
基金运作方式:契约型、开放式
基金合同生效日:2013年04月25日
报告期末基金份额总额:439,634,302.37

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: 5,533,636.41
2.本期利润: 1,496,543.10
3.加权平均基金份额本期利润: 0.0043
4.期末基金资产净值: 443,946,532.09
5.期末基金份额净值: 1.0100

3.2 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 120403 120403 255,250 25,471,397.50 5.74



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明
张健 本基金的基金经理 2013年08月29日 - 3 金融学硕士,中国银河证券资产管理部高级研究员

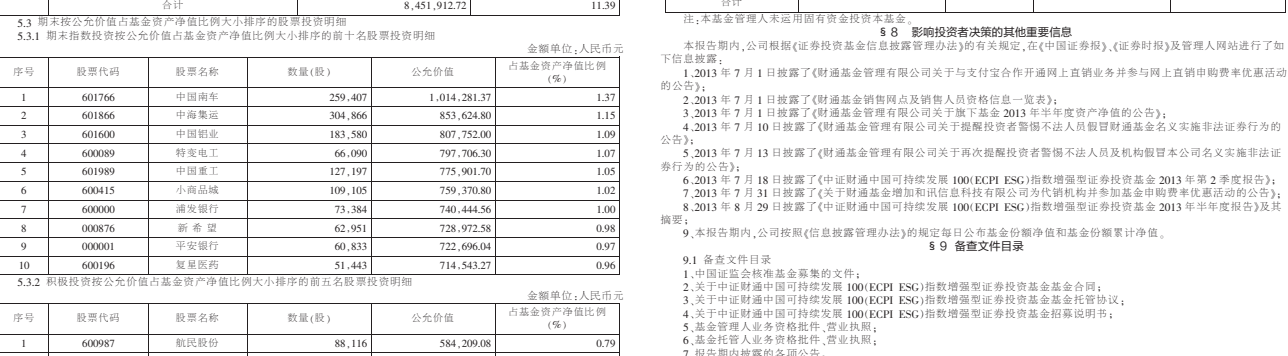
1.1 基金合同生效以来基金投资业绩与比较基准的比较
1.2 基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
1.3 基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
报告截止日期:2013年10月23日

基金概况
基金名称:中证财通中国可持续发展100(ESPI ESG)指数增强型证券投资基金
基金代码:000042
基金运作方式:契约型、开放式
基金合同生效日:2013年03月22日
报告期末基金份额总额:76,122,133.20

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: 11,993,147.40
2.本期利润: 2,191,055.06
3.加权平均基金份额本期利润: 0.205
4.期末基金资产净值: 107,520,000.00
5.期末基金份额净值: 1.026

3.2 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 601318 中国平安 170,000 6,099,000.00 6.72



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
报告截止日期:2013年10月23日

基金概况
基金名称:德邦中证500指数增强型证券投资基金
基金代码:770002
基金运作方式:契约型、开放式
基金合同生效日:2013年03月22日
报告期末基金份额总额:76,122,133.20

中证财通中国可持续发展 100(ESPI ESG)指数增强型证券投资基金

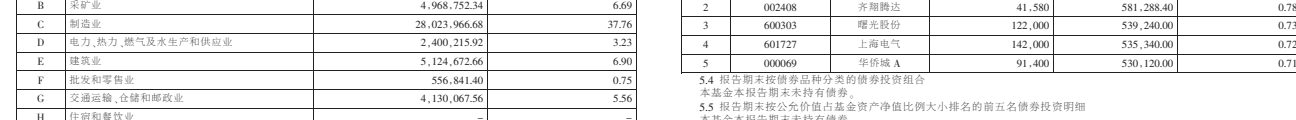
2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金概况
基金名称:中证财通中国可持续发展100(ESPI ESG)指数增强型证券投资基金
基金代码:000042
基金运作方式:契约型、开放式
基金合同生效日:2013年03月22日
报告期末基金份额总额:76,122,133.20

3.1 主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益: -2,105,833.41
2.本期利润: -5,685,738.80
3.加权平均基金份额本期利润: 0.0720
4.期末基金资产净值: 74,221,261.30
5.期末基金份额净值: 0.9751

3.2 本报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 601318 中国平安 170,000 6,099,000.00 6.72



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
报告截止日期:2013年10月23日

上、三季度我们继续采用谨慎的建仓策略,通过对指数成分券及各债券的分层抽样复制,构建本基金债券投资组合,在严格的投资纪律约束下,运用量化的风险管理手段,投资组合波动较小,保障了投资者的收益。

本报告期内,本基金净值增长率为0.4%,同期业绩比较基准(中证1-7年中高收益企业债指数*90%+银行活期存款利率(税后)*10%)增长率为0.4%,按照基金合同的约定,本基金基金合同生效日起6个月内,本基金净值增长率未达到上述目标,本基金将处于建仓期。

5.1 报告期末基金资产组合情况
序号 项目 金额 占基金总资产比例(%)
1 权益投资 -- --
2 债券投资 -- --
3 货币资金 -- --
4 其他资产 -- --

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值 占基金资产净值比例(%)
1 120403 120403 255,250 25,471,397.50 5.74

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
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 120403 120403 255,250 25,471,397.50 5.74

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

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
报告截止日期:2013年10月23日