大成保本混合型证券投资基金

【2013】第一季度报告

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2013年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成保本混合
交易代码	090013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月20日
报告期末基金份额总额	707,341,212.55份
投资目标	依照保证合同,本基金通过运用组合保险策略,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金投资采用VPPI可变组合保险策略(Variable Proportion Portfolio Insurance)。VPPI策略是国际投资管理领域中一种常见的投资组合保险机制,将基金资产分配在保本资产和风险资产上;并根据数量分析、市场波动等来调整,修正风险资产与保本资产在投资组合中的比重,在保证风险资产可能的损失额不超过扣除相关费用后的保本资产的潜在收益与基金前期收益的基础上,参与分享市场可能出现的风险收益,从而保证本金安全,并实现基金资产长期增值。保本资产主要包括货币市场工具和债券等低风险资产,其中债券包括国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、可分离债券、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具;风险资产主要包括股票、权证等高风险资产。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率(税后)。指按照基金合同生效日或新的保本周期开始日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率(按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位,单位为百分数)计算的与当期保本周期同期限的税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。
基金管理人	大成基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金保证人	中国投资担保有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	14,487,028.30
2.本期利润	15,283,928.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0207
4.期末基金资产净值	744,088,004.66
5.期末基金份额净值	1.052

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。

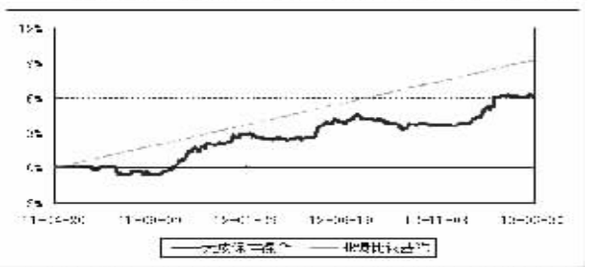
2、所述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.93%	0.12%	1.08%	0.00%	0.85%	0.12%

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



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的规定,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

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
		任职日期	离任日期		
陈尚前先生	本基金基金经理、固定收益部总监	2011年4月20日	-	14年	南开大学经济学博士。曾任中国平安保险公司投资管理中心债券投资室主任和招商证券股份有限公司研究发展中心策略部经理。2002年加盟大成基金管理有限公司,2003年6月至2009年5月曾任大成债券基金基金经理,2008年8月6日开始担任大成强化收益债券基金基金经理,2010年10月15日开始兼任大成景丰分级债券型证券投资基金基金经理,2011年4月20日起同时兼任大成保本混合型证券投资基金基金经理。现同时担任公司固定收益部总监,固定收益投资决策委员会主席,负责公司固定收益证券投资业务,并兼任大成国际资产管理有限公司董事。具有基金从业资格。国籍:中国
朱文辉先生	本基金基金经理	2011年6月4日	-	13年	工商管理硕士。2000年9月至2002年1月就职于平安保险集团总公司投资管理中心任债券研究员;2002年1月至2003年1月就职于东方保险股份有限公司投资管理中心任债券投资经理,2003年1月至2005年12月就职于生命人寿保险股份有限公司资产管理部任助理总经理;2006年1月至2010年12月就职于汇丰晋信基金管理有限公司基金投资部任固定收益投资副总监,2008年12月3日至2010年12月4日兼任汇丰晋信平稳增利债券型证券投资基金基金经理。2011年加入大成基金管理有限公司,2011年6月4日开始担任大成保本混合型证券投资基金基金经理。2011年11月30日起担任大成可转债增强债券基金基金经理。2012年6月15日起担任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业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》、《大成保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成保本混合型证券投资基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2013年1季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在4笔同日反向交易,原因是投资组合投资策略需要。主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但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均不超过该股当日成交量5%;投资组合间不存在债券同日反向交易。投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年一季度,国内经济复苏力度低于预期,政府对房地产市场调控和影子银行的清理则超出市场预期。与此同时,通货膨胀相对温和,由于外汇占款增长较快,市场流动性保持宽松。一季度的市场来看,沪深300指数全季度下跌1.1%,中信标普可转债指数上涨5.6%,纯债市场以中债综合指数为例上涨1.4%。

考虑到本基金的产品特征,我们基于"严格风险控制,追求稳健收益"的投资原则:大类资产配置上,超配固定收益类资产,以金融债券和较高等级信用债为主,增加与保本剩余期限接近的较高等级信用债券;基于复苏弱于预期的判断,对股票资产和转债资产进行减持,以实现部分收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.052元,本报告期基金份额净值增长率为1.93%同期业绩比较基准收益率为1.08%,高于业绩比较基准的表现。

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2013年二季度,海外经济对内需拉动效果减弱,房地产市场调控和影子银行清理执行力度对实体经济的负面影响有待观察,国内经济弱复苏的可持续性面临挑战。通货膨胀相对温和,市场流动性仍较宽松。在此背景下,预计债券市场继续提供稳定收益回报,股票市场和转债市场以结构性机会为主。

本基金将继续通过固定收益证券投资积累安全垫,严格控制信用风险。在控制整体组合下行风险的前提下,加大转债市场的投资比例,以提高组合的投资收益。

我们非常感谢基金份额持有人的信任和支持,我们将继续按照本基金合同和风险收益特征的要求,严格控制投资风险,积极进行资产配置,适时调整组合结构,研究新的投资品种和挖掘投资机会,力争获得与基金风险特征一致的稳定收益,以回报给投资者。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,865,292.36	1.46
	其中:股票	10,865,292.36	1.46
2	固定收益投资	679,759,524.00	91.11
	其中:债券	679,759,524.00	91.11
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	45,291,902.97	6.07
6	其他资产	10,185,517.85	1.37
7	合计	746,102,237.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	10,865,292.36	1.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	10,865,292.36	1.46

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002038	双鹭药业	70,000	4,375,000.00	0.59
2	002415	海康威视	100,000	3,854,000.00	0.52
3	601311	骆驼股份	199,954	2,467,432.36	0.33
4	600519	贵州茅台	1,000	168,860.00	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,586,444.00	3.98
2	央行票据	19,986,000.00	2.69
3	金融债券	318,317,000.00	42.78
	其中:政策性金融债	318,317,000.00	42.78
4	企业债券	243,385,816.00	32.71
5	企业短期融资券	50,095,000.00	6.73
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	18,389,264.00	2.47
8	其他	-	0.00
9	合计	679,759,524.00	91.35

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120414	12农发14	1,200,000	119,112,000.00	16.01
2	126011	08石化债	1,130,000	110,016,800.00	14.79
3	120229	12国开29	800,000	79,312,000.00	10.66
4	122092	11大秦01	500,000	50,340,000.00	6.77
5	112028	11冀能债	500,000	50,325,000.00	6.76

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.2 基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	58,759.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,114,870.34
5	应收申购款	11,887.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,185,517.85

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	16,294,400.00	2.19
2	110015	石化转债	1,120,400.00	0.15

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	766,957,704.51
本报告期基金总申购份额	1,689,736.33
减:本报告期基金总赎回份额	61,306,228.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	707,341,212.55

§7 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成保本混合型证券投资基金的文件;

2、《大成保本混合型证券投资基金基金合同》;

3、《大成保本混合型证券投资基金基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

8.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2013年4月22日

德邦优化配置股票型证券投资基金

【2013】第一季度报告

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
报告送出日期:2013年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	德邦优化股票
基金主代码	770001
交易代码	770001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月25日
报告期末基金份额总额	100,546,973.48份
投资目标	本基金为股票型证券投资基金,依靠对宏观经济周期的判断,结合数量化投资模型,优化配置基金资产于各类风险资产,并同时精选个股与个券,通过上述积极的组合管理投资策略,力求实现基金资产超越业绩比较基准的长期稳定增值。
投资策略	本基金强调自上而下的投资策略,通过对经济周期、行业特征与公司价值等宏观、中观、微观层面的信息进行全面分析,调整投资组合配置。具体而言,本基金具体投资策略分三个层次:第一,大类资产的配置,本基金通过分析、预判宏观经济周期及市场走势,结合美林投资时钟,分配权益类证券和固定收益类证券的投资比例,以在充分分散系统风险的同时,最大程度的提高基金资产组合投资收益;第二,根据宏观经济形势、国家产业政策、行业自身发展周期等综合因素挑选前景景气的行业进行配置;第三,通过深入的基本面分析,挑选具有持续成长性、竞争优势、估值水平合理的优质股票以及债券、权证,并结合多因素模型量化衡量投资组合在各因素上的风险暴露,综合考虑其风险收益特征,构建适应市场环境的投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95% +银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	7,061,882.05
2.本期利润	2,802,705.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0268
4.期末基金资产净值	111,630,413.29
5.期末基金份额净值	1.1102

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、所述基金业绩指标不包括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 本报告期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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.20%	0.74%	-1.01%	1.48%	3.21%	-0.74%

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

注:本基金基金合同生效日为2012年9月25日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。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2012年9月25日至2013年3月31日。

§4 管理人报告

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
		任职日期	离任日期		
白仲光	本基金的基金经理、公司副总经理兼投资总监	2012年9月25日	-	10	博士,2003年3月至2011年7月在长盛基金管理有限公司历任金融工程研究员,长盛中证100指数证券投资基金基金经理,量化投资总监;2011年11月至2012年3月在德邦基金管理有限公司(筹)任投资总监;2012年3月起任德邦基金管理有限公司投资总监,2012年7月起任德邦基金管理有限公司副总经理。

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。

4.3 公平交易专项说明

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,从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在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,且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度股票市场冲高回落,除一月小幅上涨外,春节后即持续低迷,到3月底指数跌回到去年底收盘水平之下。本基金继续执行量化策略,以价值为主线精选个股,自下而上选择基本面持续转好、未来成长性有保障的上市公司,深入分析这些公司潜在的政策红利,运用系列量化指标衡量股票价值,坚持在价值严重低估时谨慎持仓,在本季度内较好的规避了调整风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为2.20%,同期业绩比较基准(沪深300指数增长率*95%+活期存款利率*5%)增长率为-1.01%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济弱复苏的基本格局将延续,外贸增长强劲鼓舞信心,并且对冲内需增长疲软风险,投资增长受基建拉动将有所加速,但宏观经济将持续受房地产调控升级制约。二季度,宏观经济增长将继续小幅提速,并且物价上行压力不大,流动性管制风险较小,提供证券市场重要政策窗口期。经过充分调整后的证券市场,在窗口期内应有阶段性机会,尤其有政策红利的行业中的优秀公司,在价值低估后值得买入。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	72,088,051.38	64.27
	其中:股票	72,088,051.38	64.27
2	固定收益投资	15,148,278.40	13.51
	其中:债券	15,148,278.40	13.51
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	24,077,226.65	21.47
6	其他各项资产	850,881.67	0.76
7	合计	112,164,438.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,018,974.40	33.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,279,743.00	12.79
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,277,517.00	3.83
G	交通运输、仓储和邮政业	4,868,247.78	4.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,918,569.20	2.61
J	金融业	8,725,000.00	7.82
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	72,088,051.38	64.58

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	1,300,000	5,265,000.00	4.72
2	600900	长江电力	700,100	5,201,743.00	4.66
3	600563	法拉电子	300,000	4,962,000.00	4.45
4	600011	华能国际	670,000	4,623,000.00	4.14
5	601006	大秦铁路	600,000	4,470,000.00	4.00
6	600795	国电电力	1,500,000	4,455,000.00	3.99
7	000830	鲁西化工	1,000,000	4,380,000.00	3.92
8	601607	上海医药	324,300	4,277,517.00	3.83
9	601766	中国南车	1,000,000	4,090,000.00	3.66
10	000568	泸州老窖	150,000	3,825,000.00	3.43

5.4 报告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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	14,620,200.00	13.10
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	528,078.40	0.47
8	其他	-	-
9	合计	15,148,278.40	13.57

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	122601	12白山债	50,000	5,127,000.00	4.59
2	122694	12兴荣债	30,000	3,234,900.00	2.90
3	122643	12海资债	30,000	3,185,100.00	2.85
4	122181	12山鹰债	30,000	3,073,200.00	2.75
5	110011	歌华转债	5,510	528,078.40	0.47

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.2 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股票库之外的股票。

5.9.3 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	75,631.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	669,845.67
5	应收申购款	105,404.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	850,881.67

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110011	歌华转债	528,078.40	0.47

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	122,196,498.15
本报告期基金总申购份额	5,083,600.06
减:本报告期基金总赎回份额	26,733,124.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	100,546,973.48

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

3、德邦优化配置股票型证券投资基金基金托管协议;

4、德邦优化配置股票型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。

7.2 存放地点

上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层。

7.3 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,可咨询本管理人。

咨询电话:400-821-7788

德邦基金管理有限公司
二〇一三年四月二十二日

上投摩根基金管理有限公司关于参加好买基金、数米基金申购费率优惠活动的公告

为答谢广大投资者长期以来的信任与支持,向广大投资人提供更好的服务,经上投摩根基金管理有限公司(以下简称"本公司")与上海好买基金销售有限公司(以下简称"好买基金")、杭州数米基金销售有限公司(以下简称"数米基金")协商一致,决定自2013年4月22日起,参与好买基金、数米基金的申购及定投费率优惠活动。现将有关事宜公告如下:?

一、活动时间

优惠活动时间自2013年4月22日至2013年12月31日。活动到期后自动顺延,如有变动,以好买基金、数米基金最新公告为准。

二、适用基金范围

基金代码	基金名称
371020	上投摩根纯债债券A
372010	上投摩根强化回报债券A
373010	上投摩根双息平衡混合
373020	上投摩根双核平衡混合
375010	上投摩根中国优势混合
376510	上投摩根大盘蓝筹股票
377010	上投摩根阿尔法股票
377016	上投摩根亚太优势股票(QDII)
377020	上投摩根内需动力股票
377240	上投摩根新兴动力股票
377530	上投摩根行业轮动股票
378006	上投摩根全球新兴市场股票(QDII)
378010	上投摩根成长先锋股票
379010	上投摩根中小盘股票
377150	上投摩根健康品质生活股票
378546	上投摩根全球天然资源股票(QDII)
370021	上投摩根分红添利债券A
370023	上投摩根中证消费服务领先指数
370024	上投摩根核心优选股票
370025	上投摩根轮动添利债券A
370027	上投摩根智选30股票

三、适用基金费率

投资者通过好买基金、数米基金自助式交易系统申购或定期定额投资本公司上述开放式基金(前端收费模式),其申购费率享有4折优惠。若享受折扣后申购费率低于0.6%,则按0.6%执行;若基金招募说明书条款中规定申购费等于或低于0.6%或为固定金额的,则按原招募说明书中费率规定执行,不再享有费率折扣。

四、重要提示

1、本优惠活动的折扣费率由好买基金、数米基金决定和执行,本公司根据好买基金、数米基金提供的折扣费率办理。本优惠活动解释权归好买基金、数米基金所有,且其有权对上述优惠活动内容进行变更,本公司不再另行公告。有关优惠活动具体事宜,请咨询好买基金、数米基金。

2、风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。投资者投资于各基金前应认真阅读本公司旗下基金的基金合同、招募说明书。

五、投资者可通过以下途径咨询有关详情:

1、上海好买基金销售有限公司

咨询电话:400-700-9665

网站:www.ehowbuy.com

2、杭州数米基金销售有限公司

咨询电话:400-0766-123

网站:www.fund123.cn

3、上投摩根基金管理有限公司

客服电话:400-889-4888

网址:www.51fund.com

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司
2013年4月22日

上投摩根基金管理有限公司关于上投摩根新兴动力基金继续参加农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告

为答谢广大投资者长期的信任与支持,现与中国农业银行股份有限公司(以下简称"农业银行")协商一致,本公司于2013年4月22日起,继续参加农业银行网上银行基金申购费率优惠活动,对通过农业银行网上银行申购我司上投摩根新兴动力股票型证券投资基金的投资者,实行基金申购费率4折优惠。

一、适用投资者范围

通过农业行网上银行申购上投摩根新兴动力股票型证券投资基金的合法投资者。

二、适用基金及活动时间

1、本次参与基金:

基金名称	基金代码
上投摩根新兴动力	377240

2、活动时间:

2013年4月22日至2013年6月30日

三、具体优惠费率

活动期间,投资者通过农业银行网上银行申购上述基金,实行基金申购费率4折优惠。优惠后的费率不低于0.6%;原申购费率低于0.6%,按照原费率执行。

本次基金申购费率优惠活动不适用于基金定投业务及转换业务