

德邦优化配置股票型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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:2014年1月22日

\$ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及董事会秘书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，并对其真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人及交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月20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10月1日起至12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

基金运作方式 约定开放式

基金合同期效日 2012年9月12日

报告期末基金份额总额 15,948,076.25份

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,结合行业分析及个股研究,精选具备成长性的股票进行投资,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资目标

本基金通过深入的行业分析,精选具有持续成长性、竞争优势、估值水平合理的优质股票以及债券、权证,并结合多因素量化衡量投资组合在各因面上的风险暴露,综合考虑其潜在收益特征,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,预期风险和预期回报率高于混合型基金、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10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 973,671.13

2.本期利润 970,324.33

3.加权平均基金份额本期利润 0.0194

4.期末基金份额净值 18,992,293.29

5.期末基金份额总额 1,1909

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,计人费用后实际收益水平要低于所列数字;3.基金净值重估值

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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变化图

3.2.3 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率后扣减相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.4 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,计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.5 基金净值重估值

3.2.6 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.7 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.8 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.9 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.10 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.11 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.12 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.13 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.14 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.15 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.16 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.17 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.18 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.19 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.20 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%

3.2.21 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 纯值增 平均业绩比 纯值增基 纯值增基 纯值增基 纯值增基

率① (%) 率② (%) 性比基 率③ (%) 标准差④ (%)

过去三个月 0.94% 1.27% -3.10% 1.07% 4.04% 0.20%

注:本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%