

德邦优化配置股票型证券投资基金

2015年9月30日

【2015】第三季度报告

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末,本基金运作时间已满一年。本基金的建仓期为9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约定。图示日期为2012年9月25日至215年09月30日。

4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
黎斐	本基金的基金经理	2015年04月01日 -	6	硕士,曾任职于群鼎国际控股有限公司,曾任从从事银行及上市公司分析研究工作。2014年4月起在德邦基金管理有限公司担任投资研究岗,自2014年4月起担任本公司投资研究部基金经理助理,现任本基金的基金经理,德邦基金副总经理兼基金运作部负责人兼基金风控部负责人。

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 管理人对本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约定,以取信于市场、取信于社会投资者为宗旨,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形。

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。本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
本报告期内,股票市场经历了非常强烈的回调。国内经济增速在三季度同样出现了加速回落,各种数据惨淡,整个经济开始进入真正的去库存和去产能周期。股票市场则经历了从清理场外配资开始的一系列去杠杆连锁反应,国内多个交易日连续出现千股跌停的走势,市场参与各方的杠杆资金的强平平仓风险大幅爆发,市场风险偏好从二季度末的拐点一下回落至冰点。上证指数、创业板指数等各个风格指数都出现了几乎无差别的暴跌,回调幅度达30%。整个市场的流动性被连续大面积个股跌停和成百上千家公司暂停停牌而凝固,管理层适时推出了一系列强力救市措施,短期延缓了市场的下跌节奏。在报告期内,考虑到市场风险偏好不好的情况下,以及由此带来的显著的估值回归过程,本基金对持仓进行了大比例的调整,以低估值防御品种主导组合配置,消费类龙头品种的持仓占比显著提升,在维持股票型基金仓位基准情况下,力争降低产品净值波动。

4.5 报告期内基金的投资表现
报告期内,德邦优化配置股票型基金份额净值收益率为-27.24%,同期业绩比较基准收益率为-27.06%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
报告期内,本基金存在基金资产净值连续20个工作日低于5000万元的情形。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.5 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债券投资明细

5.6 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资产支持证券投资明细

5.7 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

5.8 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权证投资明细

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.11.2 本基金本报告期末未投资股票,不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

5.12 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.13 备查文件目录

5.14 中国证监会批准设立基金的文件;

5.15 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.16 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.17 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.18 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.19 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.20 备查文件目录

5.21 中国证监会批准设立基金的文件;

5.22 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.23 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.24 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.25 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.26 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.27 备查文件目录

5.28 中国证监会批准设立基金的文件;

5.29 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.30 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.31 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.32 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.33 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.34 备查文件目录

5.35 中国证监会批准设立基金的文件;

5.36 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.37 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.38 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.39 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.40 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.41 备查文件目录

5.42 中国证监会批准设立基金的文件;

5.43 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.44 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.45 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.46 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.47 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.48 备查文件目录

5.49 中国证监会批准设立基金的文件;

5.50 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.51 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.52 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.53 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.54 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.55 备查文件目录

5.56 中国证监会批准设立基金的文件;

5.57 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.58 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.59 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.60 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.61 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.62 备查文件目录

5.63 中国证监会批准设立基金的文件;

5.64 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.65 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.66 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.67 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.68 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.69 备查文件目录

5.70 中国证监会批准设立基金的文件;

5.71 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.72 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.73 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.74 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.75 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.76 备查文件目录

5.77 中国证监会批准设立基金的文件;

5.78 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.79 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.80 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.81 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.82 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.83 备查文件目录

5.84 中国证监会批准设立基金的文件;

5.85 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.86 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.87 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.88 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.89 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.90 备查文件目录

5.91 中国证监会批准设立基金的文件;

5.92 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.93 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.94 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.95 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.96 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.97 备查文件目录

5.98 中国证监会批准设立基金的文件;

5.99 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.100 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.101 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.102 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.103 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.104 备查文件目录

5.105 中国证监会批准设立基金的文件;

5.106 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.107 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.108 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.109 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.110 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.111 备查文件目录

5.112 中国证监会批准设立基金的文件;

5.113 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.114 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.115 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.116 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.117 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.118 备查文件目录

5.119 中国证监会批准设立基金的文件;

5.120 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.121 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.122 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.123 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.124 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.125 备查文件目录

5.126 中国证监会批准设立基金的文件;

5.127 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.128 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.129 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.130 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.131 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.132 备查文件目录

5.133 中国证监会批准设立基金的文件;

5.134 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.135 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.136 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.137 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.138 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.139 备查文件目录

5.140 中国证监会批准设立基金的文件;

5.141 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.142 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.143 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.144 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.145 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.146 备查文件目录

5.147 中国证监会批准设立基金的文件;

5.148 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.149 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.150 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.151 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.152 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.153 备查文件目录

5.154 中国证监会批准设立基金的文件;

5.155 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.156 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.157 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.158 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.159 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.160 备查文件目录

5.161 中国证监会批准设立基金的文件;

5.162 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.163 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.164 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.165 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.166 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.167 备查文件目录

5.168 中国证监会批准设立基金的文件;

5.169 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.170 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.171 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.172 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.173 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.174 备查文件目录

5.175 中国证监会批准设立基金的文件;

5.176 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.177 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.178 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.179 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.180 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.181 备查文件目录

5.182 中国证监会批准设立基金的文件;

5.183 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.184 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.185 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.186 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.187 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.188 备查文件目录

5.189 中国证监会批准设立基金的文件;

5.190 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.191 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.192 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.193 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.194 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.195 备查文件目录

5.196 中国证监会批准设立基金的文件;

5.197 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.198 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.199 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.200 报告期内按照规定披露的年度报告;

5.201 基金管理人运用固有资金投资本基金情况;

5.202 备查文件目录

5.203 中国证监会批准设立基金的文件;

5.204 德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同;

5.205 德邦优化配置股票型证券投资基金招募说明书;

5.206 基金管理人业务资格批件、营业执照;

5.207 报告期内按照规定披露的年度报告