

德邦纯债9个月定期开放债券型证券投资基金

2017年第三季度报告

为公宗,本被诚实信用,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的利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人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不公平交易的情况。

4.2 异常交易行为专项说明

报告期内,本基金未发现异常交易行为。本基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年三季度,经济数据出现回落,而通胀略有上行,监管和金融方面,德月工作会议强调,市场期待降准预期有所放松之后,进入三季度,先后有金融工作会议、国开行单列AMPA贷款及公募基金流动性新规,目的是为了防范金融风险及引导金融回归实体经济。

4.5 投资组合报告

截至本报告期末德邦纯债9个月定期开放债券型证券投资基金资产净值为1,024.23亿元,本报告期基金份额净值增长率为0.04%;同期业绩比较基准收益率为-0.05%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注: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序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.6 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注: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序的前五名资产支持证券

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.10 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衍生品投资

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.11 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.12 报告期末按行业分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.13 报告期末按行业分类的境内债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有境内债券。

5.14 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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.15 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.16 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.17 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.18 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.19 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.20 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.21 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.22 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.23 报告期末按行业分类的港股股票投资

注:本基金本报告期末未持有港股股票。

5.24 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.25 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债券投资

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.26 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.27 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.28 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.29 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.30 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.31 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.32 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.33 报告期末按行业分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.34 报告期末按行业分类的境内债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有境内债券。

5.35 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债券

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.36 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.37 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.38 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.39 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.40 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.41 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.42 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.43 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.44 报告期末按行业分类的港股股票投资

注:本基金本报告期末未持有港股股票。

5.45 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.46 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债券

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.47 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.48 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.49 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.50 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.51 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.52 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.53 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.54 报告期末按行业分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.55 报告期末按行业分类的境内债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有境内债券。

5.56 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债券

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.57 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.58 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.59 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.60 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.61 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.62 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.63 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.64 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.65 报告期末按行业分类的港股股票投资

注:本基金本报告期末未持有港股股票。

5.66 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.67 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债券

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.68 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.69 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.70 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.71 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.72 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.73 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.74 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.75 报告期末按行业分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.76 报告期末按行业分类的境内债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有境内债券。

5.77 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债券

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.78 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.79 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.80 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.81 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.82 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.83 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.84 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.85 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.86 报告期末按行业分类的港股股票投资

注:本基金本报告期末未持有港股股票。

5.87 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.88 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债券

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.89 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.90 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.91 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.92 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.93 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.94 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.95 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.96 报告期末按行业分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.97 报告期末按行业分类的境内债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有境内债券。

5.98 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债券

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.99 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.100 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.101 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.102 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.103 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.104 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.105 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.106 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.107 报告期末按行业分类的港股股票投资

注:本基金本报告期末未持有港股股票。

5.108 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.109 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债券

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.110 报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.111 报告期末前十名存在受限受限股票的情况

注:本基金本报告期末未持有受限股票。

5.112 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.113 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.114 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资产支持

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.115 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衍生品

注:本基金本报告期末未持有衍生品。

5.116 其他资产构成

注:本基金本报告期末未持有其他资产。

5.117 报告期末按行业分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.118 报告期末按行业分类的境内债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有境内债券。