德邦优化灵活配置混合型证券投资基金
2016年年度报告 摘要

2016年 12月 31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

送出日期：2017年 3 月 27日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2017年 03月 24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2016年 01月 01日起至 2016年 12月 31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	德邦优化
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	629,234,972.72份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型证券投资基金，依靠对宏观经济周期的判断，结合数量化投资模型，灵活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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%＋一年期银行定期存款利率（税后）×60%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		德邦基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李定荣	陆志俊
	联系电话	021-26010999	95559
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008217788	95559
传真		021-26010808	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.dbfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-3,296,885.76	7,729,022.24	3,951,777.71
本期利润	-9,112,751.50	9,452,215.04	5,165,289.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0292	0.1268	0.2706
本期基金份额净值增长率	-23.88%	26.38%	33.41%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3924	-0.2243	0.0063
期末基金资产净值	548,798,086.11	41,108,889.06	767,473,079.38
期末基金份额净值	0.8722	1.1458	1.1887

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额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

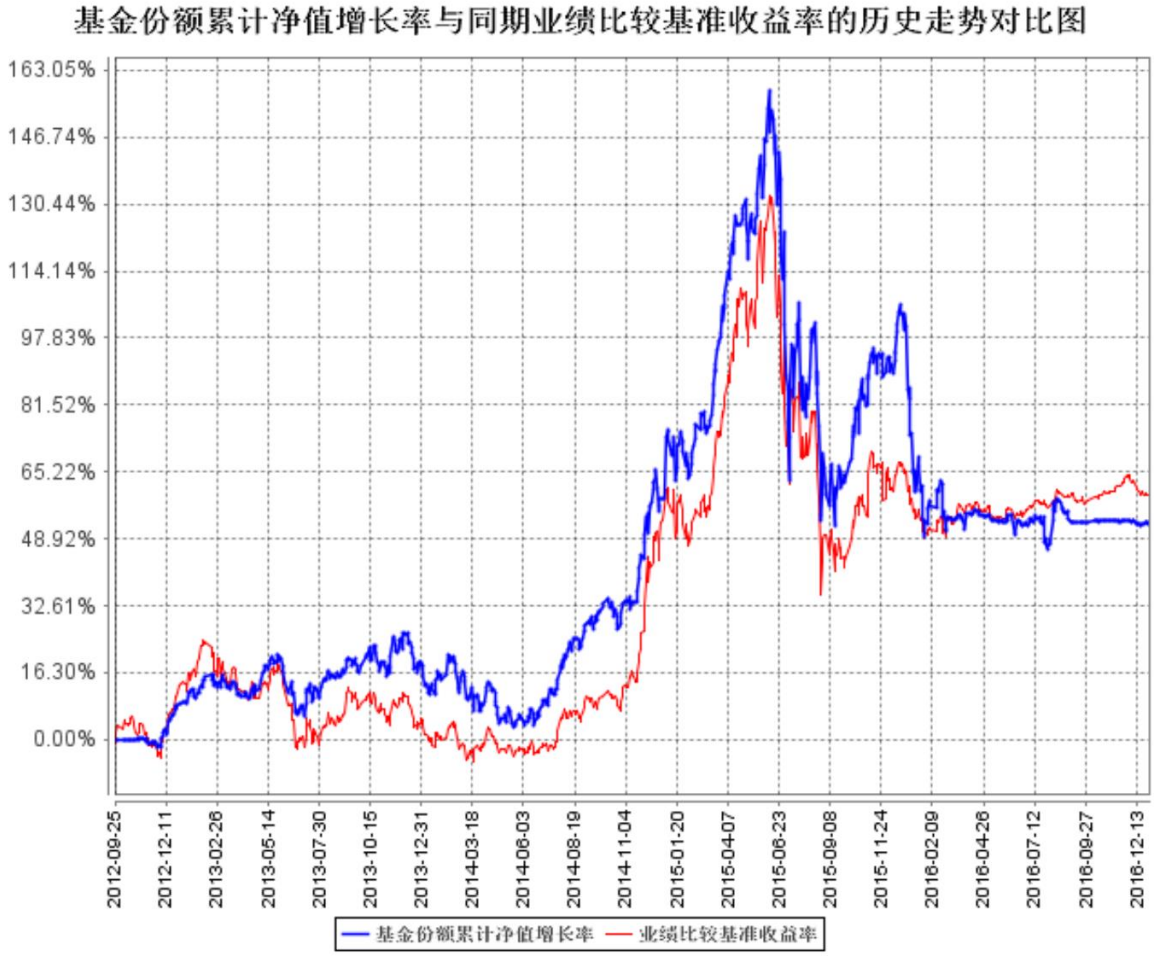
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.14%	0.09%	0.96%	0.28%	-1.10%	-0.19%
过去六个月	0.14%	0.63%	2.50%	0.30%	-2.36%	0.33%
过去一年	-23.88%	1.20%	-3.25%	0.56%	-20.63%	0.64%
过去三年	28.34%	1.79%	51.71%	1.54%	-23.37%	0.25%

自基金合同生效起至今	52.84%	1.60%	59.77%	1.48%	-6.93%	0.12%

注：本基金份额持有人大会于 2015年 12月 15日表决通过了《关于德邦优化配置股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自 2015年 12月 15日起，本基金由原德邦优化配置股票型证券投资基金变更为德邦优化灵活配置混合型证券投资基金，业绩比较基准由原沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%变更为沪深 300 指数收益率×40%+一年期银行定期存款利率（税后）×60%。

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

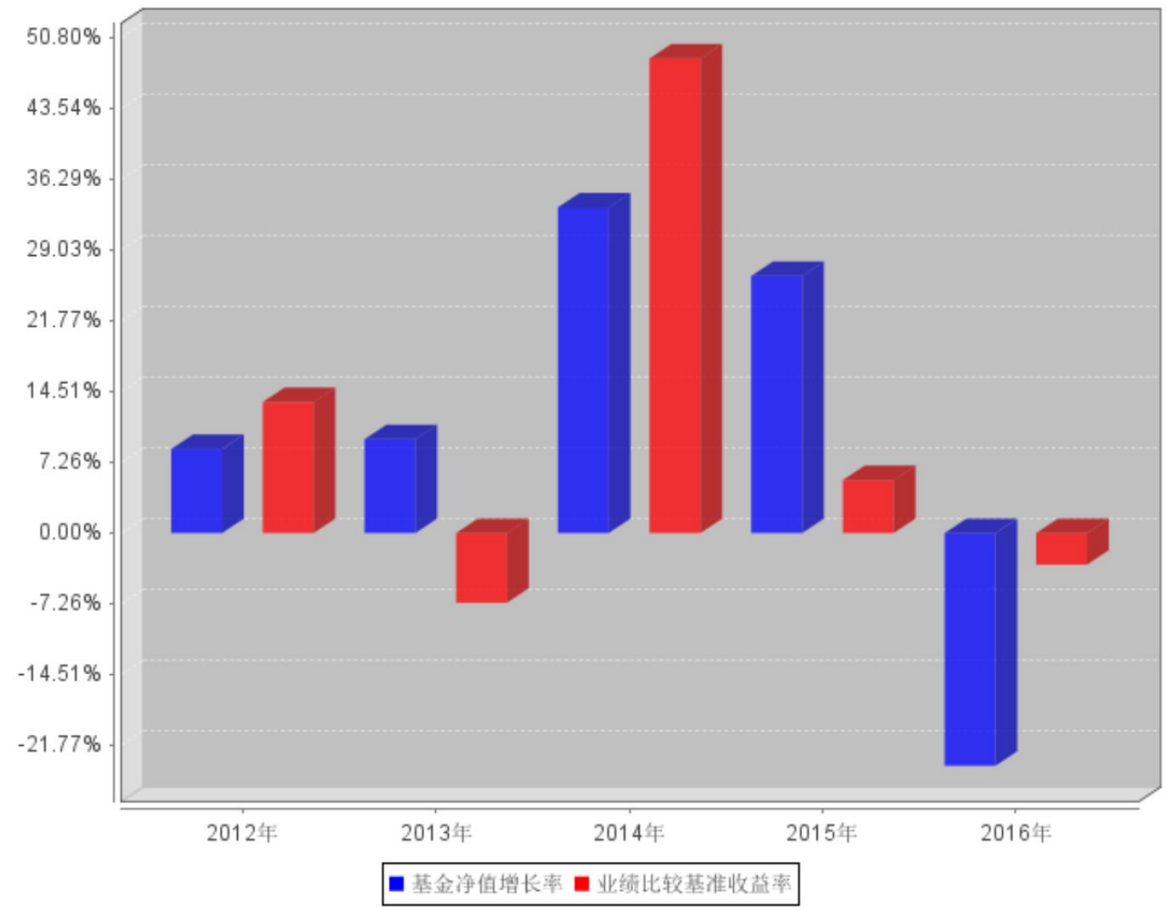


注：本基金份额持有人大会于 2015年 12月 15日表决通过了《关于德邦优化配置股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自 2015年 12月 15日起，本基金由原德邦优化配置股票型证券投资基金变更为德邦优化灵活配置混合型证券投资基金，基金转型起至报告期期末，本基金运作时间已满一年。业绩比较基准由原沪深 300指数收益率*95%+银行活期存款税后利率*5%变更为沪深 300 指数收益率×40%＋一年期银行定期存款利率（税后）×60%。本基金的建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金基金合同规定。图示日期为 2012年 9 月 25日至 2016年 12

月 31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2012年 9 月 25日，2012年度数据根据合同生效当年实际存续期(2012年 9 月 25日至 2012年 12月 31日)计算,不按照整个自然年度进行折算。本基金份额持有人大会于 2015年 12月 15日表决通过了《关于德邦优化配置股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自 2015年 12月 15日起，本基金由原德邦优化配置股票型证券投资基金变更为德邦优化灵活配置混合型证券投资基金，业绩比较基准由原沪深 300指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%变更为沪深 300指数收益率×40%+一年期银行定期存款利率（税后）×60%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	
2015	4	1,216,246,279.82	5,287,764.93	1,221,534,044.75	

2014	4	257,200,164.77	367,273.24	257,567,438.01	
合计	8	1,473,446,444.59	5,655,038.17	1,479,101,482.76	

注：本基金自 2014年 01月 01日至 2016年 12月 31日进行了 2 次利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

德邦基金管理有限公司经中国证监会（证监许可[2012]249号）批准，于 2012 年 3 月 27 日正式成立。股东为德邦证券股份有限公司、西子联合控股有限公司、浙江省土产畜产进出口集团有限公司，注册资本为 2 亿元人民币。公司以修身、齐家、立业、助天下为己任，秉持长期的价值投资理念，坚守严谨的风险控制底线，致力于增加客户财富，为客户提供卓越的理财服务。

截止 2016年 12月 31日，本基金管理人共管理二十只开放式基金：德邦多元回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦如意货币市场基金、德邦纯债 9 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦纯债一年定期开放债券型证券投资基金、德邦景颐债券型证券投资基金、德邦德焕 9 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦德景一年定期开放债券型证券投资基金、德邦现金宝交易型货币市场基金、德邦锐璟债券型证券投资基金、德邦增利货币市场基金、德邦纯债 18个月定期开放债券型证券投资基金、德邦优化灵活配置混合型证券投资基金、德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金、德邦德利货币市场基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦纯债债券型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星稳健灵活配置混合型证券投资基金和德邦新添利债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许文波	公司投资研究部副总经理兼研究部总监。本基金的基金经理、德邦纯债债券型证券投资基金、德邦	2015年 12月 23日	-	15年	硕士，历任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师，东北证券股份有限公司上海分公司投资经理，2015年 7月加入德邦基金管理有限公司，现任本公司投资研究部副总经理兼研究部总监、本公司基金经理。

	新添利债券型证券投资基金、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。				
黎莹	德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2015年6月9日	2016年9月28日	6年	硕士，曾任职于群益国际控股有限公司上海代表处从事行业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任投资研究部研究员。自 2015 年 4 月起任本公司投资研究部基金经理助理，现任本公司基金经理。
孔飞	本基金的基金经理。	2016 年 2 月 18日	-	5年	学士，2001 年 2 月至 2011 年 2 月在平安保险深圳分公司南新营业区担任经理；2011 年3月至2015年12月在中投证券上海分公司创新业务部担任总经理助理；2015 年 12 月加入德邦基金管理有限公司,担任产品经理。现任本公司基金经理。
刘长俊	本基金的基金经理、德邦德焕 9 个月定期开放债券型证券投资基金、德邦德景一年定期开放债券型证券投资	2016年11月9日	-	6年	硕士，2012 年 7 月至 2013 年 3 月担任上海大智慧股份有限公司宏观行业部研究员；2013年3月至2015年6月担任上海新世纪资信评估投资服务有限公司债项评级部分析师。2015年6月加入德邦基金管理有限公司，任职于投资研究部，现任本公司基金经理。

	基金、德邦纯债债券型证券投资基金的基金经理。				

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《证券法》、《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，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易控制机制，确保管理的不同受托资产得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，本基金管理人建立了科学的研究方法以及规范的研究管理平台， 实行证券备选库和交易对手备选库制度，各受托资产之间实行防火墙制度，通过系统的投资决策方法和明确的投资授权制度，保证受托投资决策的客观性和独立性。

在交易执行方面，本基金管理人实行集中交易制度，并建立了公平的交易分配流程， 保证投资指令得以公平对待。对以本基金管理人的名义参与债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易的，相关基金经理或投资经理应独立确定各受托资产拟申购的价格和数量，基金管理人在获配额度后，按照价格优先、比例分配的原则进行分配。对以各受托资产名义参与银行间交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的，交易部应充分询价，利用市场公认的第三方信息对交易价格的公允性进行审查，确保各受托资产获得公平的交易机会。

监察稽核部门对投资交易行为进行定期或不定期检查，重点关注公平交易的执行情况和异常

交易行为的监控情况。严禁同一受托资产的同日反向交易及其他可能导致不公平或利益输送的交易行为，但完全按照有关指数构成比例进行证券投资的受托资产除外。严格控制不同受托资产间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易或利益输送的同日反向交易行为。监察稽核部门对不同受托资产，尤其是同一位基金经理或投资经理管理的不同受托资产同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同受托资产临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。发现异常交易情况的，可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。监察稽核部门对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同受托资产买卖该异常交易证券的情况进行分析。发现异常交易情况的，可要求相关基金经理或投资经理对交易的合理性进行解释。监察稽核部门编制定期公平交易报告，重点分析本基金管理人管理的不同受托资产整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及同一期间、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同受托资产同向交易的交易价差。公平交易报告由基金经理或投资经理确认后报督察长、总经理审阅。

4.3.2 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，对投资交易行为进行监察稽核，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，借助 IT系统和人工监控等方式在各个环节严格控制交易公平执行；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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，且未发现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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年一季度市场经历了熔断及人民币汇率波动后，1-2 月持续震荡走势，3 月小幅反弹。

市场处于存量资金博弈，场外资金保持观望。二季度受到美联储加息、MSCI、英国公投等事件的影响，大盘保持盘整态势. 三季度市场继续处于震荡盘底阶段，无趋势性行情。四季度判断筑底结束会有小波段机会。整体来说 16年市场仍处于震荡筑底阶段，属于震荡市，面对此种市场加大仓位配置国企改革等大蓝筹股票，规避估值过高的中小板、创业板股票。采取积极的价值投资策略，精选个股，获取相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-23.88%，同期业绩比较基准增长率为-3.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年，中国经济运行“稳”字当头，各方面保持在合理区间，可总体平稳、稳中有进、稳中向好，并且企稳的因素在不断积累。中国经济增速连续三个季度稳在 6.7%;投资缓中趋稳、消费稳健有升、出口由降转升;PPI打破 54个月持续为负的局面，生产领域通缩明显缓解;制造业 PMI 连续 4 个月站上荣枯线，并升至两年来高点，市场预期转暖.

预估 2017年固定资产投资增速可能略有下降，而外需有望温和复苏。全年 CPI可能在 1.7%左右，走势较为平稳；全年 PPI或将从 2016年的-1.6%进一步回升至 1.9%。短期内货币政策可能没有宽松的空间，鉴于真实利率已经在经济再通胀（尤其是房价上行）后明显下降。预计 2017年基准利率将保持不变。2017年财政政策仍将在稳增长中发挥主要作用，但政策组合可能更着重于提振消费需求，而非投资支出。财政政策有望从减税和增加补贴两方面促进居民收入和消费增长，以及增加教育、医疗和扶贫等方面的公共支出。

2017年 A 股将呈现震荡格局，可以寻找结构性机会。供给侧结构性改革持续推进，旧泡沫将被逐步刺破，经济将在冲击中构筑新的增长动力，关注受政策与改革预期支持且估值在合理范围的周期性板块：（1）精选大消费，特别是受新技术、新模式影响的类别，主要在医药、TMT、教育、物流、食品饮料、家居等与消费相关领域精选个股逢低吸纳，同时金融中的中小银行、互联网金融等领域也值得关注；（2）阶段性关注受政策与改革预期支持且估值在合理范围的周期性板块。国企改革、5G、破坏性创新（人工智能等）、教育与文化、军工等值得阶段性关注。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人继续坚持以维护基金份额持有人利益为宗旨，以规范运作、防范风险、维护投资人利益为原则，严格依据法律法规和公司内控制度进行监察稽核工作，切实防范公司运营和投资组合运作的风险，保障公司稳步发展。

合规管理方面，进一步推动完善规章制度，强化业务流程的规范化和系统化，适应各类业务的发展和法律规范的要求；加强合规管理工作，严格审核产品及业务法律文件、宣传推介材料、制度流程、信息披露等文件；通过组织各类形式的培训努力提高员工合规意识，提升业务技能。风险管理方面，通过事前、事中、事后多维度对各类风险进行管控和防范，并通过双岗复核机制防范操作风险；继续对风险管理系统进行升级和完善，丰富风险管理手段，做好投资行为的投资监督和风险管理。稽核审计方面，严格按照法律规范的要求做好定期审计和专项审计工作，并加强投研、销售等重点环节的审计监督频率和深度，防范业务风险。

综合以上情况，2016年，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续加强内部合规控制、风险管理以及稽核审计工作，防范和控制各种风险，合法合规、诚实信用、勤勉尽责地运作基金财产。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《德邦基金基金估值业务管理制度》、《德邦基金估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员包括总经理、分管投资副总或投资总监、督察长、基金经理、金融工程与量化投资部、研究发展部、运作保障部负责人、基金会计及监察稽核部等相关专业人士组成。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督， 确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后或基金资产在采用新投资策略和新品种时，估值委员会应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值委员会修订相关估值方法，以确保其持续适用。涉及估值政策的变更均须经估值委员会决议批准后执行。

在每个估值日，本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值，确定证券投资基金的份额净值。基金管理人对基金资产进行估值后，将估值结果发送基金托管人。基金托管人则按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以对外公布。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内自 2016年 1 月 4 日至 2016年 3 月 3 日、2016年 7 月 5 日至 2016年 9 月 5 日期间出现连续 20个工作日基金资产净值低于 5000万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人--德邦基金管理有限公司在本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由本基金管理人--德邦基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2017)审字第 60982868_B04号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	德邦优化灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的德邦优化灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2016年 12月 31日的资产负债表、2016年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人德邦基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了德邦优化灵活配置混合型证券投资基金 2016年 12月 31日的财务状况以及 2016年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	陈 露	蔺育化
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16层	
审计报告日期	2017年 3 月 24日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：德邦优化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2016年 12月 31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年 12月 31日	上年度末 2015年 12月 31日
资 产：			
银行存款		38,260,324.82	5,083,151.20
结算备付金		309,904.03	80,121.48
存出保证金		67,930.55	13,653.62
交易性金融资产		404,698,786.21	36,866,080.00
其中：股票投资		84,846,148.21	36,866,080.00
基金投资		-	-
债券投资		319,852,638.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		103,186,459.78	-
应收证券清算款		34,861.10	397,098.81
应收利息		3,154,639.96	1,456.69
应收股利		-	-
应收申购款		339.49	32,990.44
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		549,713,245.94	42,474,552.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年 12月 31日	上年度末 2015年 12月 31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	933,192.77
应付赎回款		2,122.66	123,199.44
应付管理人报酬		390,567.52	50,797.05
应付托管费		162,736.45	8,466.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		180,725.20	60,545.89
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		179,008.00	189,461.86
负债合计		915,159.83	1,365,663.18
所有者权益：			

实收基金		629,234,972.72	35,878,878.46
未分配利润		-80,436,886.61	5,230,010.60
所有者权益合计		548,798,086.11	41,108,889.06
负债和所有者权益总计		549,713,245.94	42,474,552.24

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8722 元，基金份额总额 629,234,972.72 份。

7.2 利润表

会计主体：德邦优化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期： 2016年 1 月 1 日至 2016年 12月 31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年 1 月 1 日至 2016年 12月 31日	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015年 12月 31日
一、收入		-4,262,465.63	12,303,949.74
1.利息收入		5,448,997.56	1,282,420.90
其中：存款利息收入		368,195.37	818,240.18
债券利息收入		4,168,201.09	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		912,601.10	464,180.72
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,306,997.38	3,325,211.81
其中：股票投资收益		-893,055.71	3,158,712.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-3,502,492.17	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		88,550.50	166,499.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-5,815,865.74	1,723,192.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		411,399.93	5,973,124.23
减：二、费用		4,850,285.87	2,851,734.70
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	3,168,232.17	1,759,374.93
2. 托管费	7.4.8.2.2	692,343.23	293,229.19
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		810,405.47	582,730.58
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用		179,305.00	216,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,112,751.50	9,452,215.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,112,751.50	9,452,215.04

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：德邦优化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年 1 月 1 日至 2016年 12月 31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年 1 月 1 日至 2016年 12月 31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	35,878,878.46	5,230,010.60	41,108,889.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-9,112,751.50	-9,112,751.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	593,356,094.26	-76,554,145.71	516,801,948.55
其中：1.基金申购款	968,245,705.65	-121,915,007.22	846,330,698.43
2.基金赎回款	-374,889,611.39	45,360,861.51	-329,528,749.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	629,234,972.72	-80,436,886.61	548,798,086.11
项目	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015年 12月 31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	645,626,054.12	121,847,025.26	767,473,079.38
二、本期经营活动产生的	-	9,452,215.04	9,452,215.04

以上内容仅为本文档的试下载部分，为可阅读页数的一半内容。如要下载或阅读全文，请访问：https://d.book118.com/235240211224012011

基金净值变动数（本期净利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-609,747,175.66	1,095,464,815.05	485,717,639.39
其中：1.基金申购款	3,153,499,564.68	2,112,206,078.10	5,265,705,642.78
2.基金赎回款	-3,763,246,740.34	-1,016,741,263.05	-4,779,988,003.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,221,534,044.75	-1,221,534,044.75
五、期末所有者权益（基金净值）	35,878,878.46	5,230,010.60	41,108,889.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

易强	易强	刘为臻
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

德邦优化灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")，原德邦优化配置股票型证券投资基金，系经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2012]941 号文《关于核准德邦优化配置股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人德邦基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2012 年 9 月 25 日正式生效，首次设立募集规模为 323,120,876.78份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为德邦基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

德邦优化配置股票型证券投资基金自 2015年 11月 28日至 2015年 12月 14日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2015年 12月 15日表决讨论通过了《关于德邦优化配置股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，决议事项已向中国证监会的备案。自 2015年 12月 15日起，由《德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《德邦优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《德邦优化配置股票型证券投资基金基金合同》同日起失效。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、