

德邦德利货币市场基金2015年半年度报告

2015年6月30日

基金管理人：德邦基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2015年8月27日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月25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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.6 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 债券回购融资情况.....	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	36
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	39
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	40
7.8 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	42
10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	43

10.9 其他重大事件.....	44
§11 备查文件目录.....	46
11.1 备查文件目录.....	46
11.2 存放地点.....	46
11.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	德邦德利货币市场基金	
基金简称	德邦德利货币	
基金主代码	000300	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年9月16日	
基金管理人	德邦基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,436,147,594.23份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	德邦德利货币A	德邦德利货币B
下属两级基金的交易代码	000300	000301
报告期末下属两级基金的份 额总额	573,767,212.97份	2,862,380,381.26份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力求实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在保持组合高度流动性的前提下，结合对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等各方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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	中国民生银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	李定荣	关悦
	联系电话	021-26010999	010-58560666
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	guanyue2@cmbc.com.cn
客户服务电话	400-821-7788	95568	
传真	021-26010808	010-57092611	
注册地址	上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层	北京市西城区复兴门内大街2号	
办公地址	上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层	北京市西城区复兴门内大街2号	
邮政编码	200080	100031	
法定代表人	姚文平	董文标	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.dbfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼
注册登记机构	德邦基金管理有限公司	上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2015年1月1日-2015年6月30日）	
	德邦德利货币A	德邦德利货币B
本期已实现收益	7,090,125.30	44,055,545.56
本期利润	7,090,125.30	44,055,545.56
本期净值收益率	2.26%	2.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末基金资产净值	573,767,212.97	2,862,380,381.26
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)	
累计净值收益率	8.66%	9.13%

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2、上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要低于所列数字；

3、本基金收益分配为按月结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

(1) 德邦德利货币A基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段(A级)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.3619 %	0.0078 %	0.1110 %	0.0000 %	0.2509 %	0.0078 %
过去三个月	1.1723 %	0.0065 %	0.3366 %	0.0000 %	0.8357 %	0.0065 %
过去六个月	2.2586 %	0.0074 %	0.6695 %	0.0000 %	1.5891 %	0.0074 %
过去一年	4.6368 %	0.0080 %	1.3500 %	0.0000 %	3.2868 %	0.0080 %
自基金合同生效日起	8.6588 %	0.0075 %	2.4115 %	0.0000 %	6.2473 %	0.0075 %

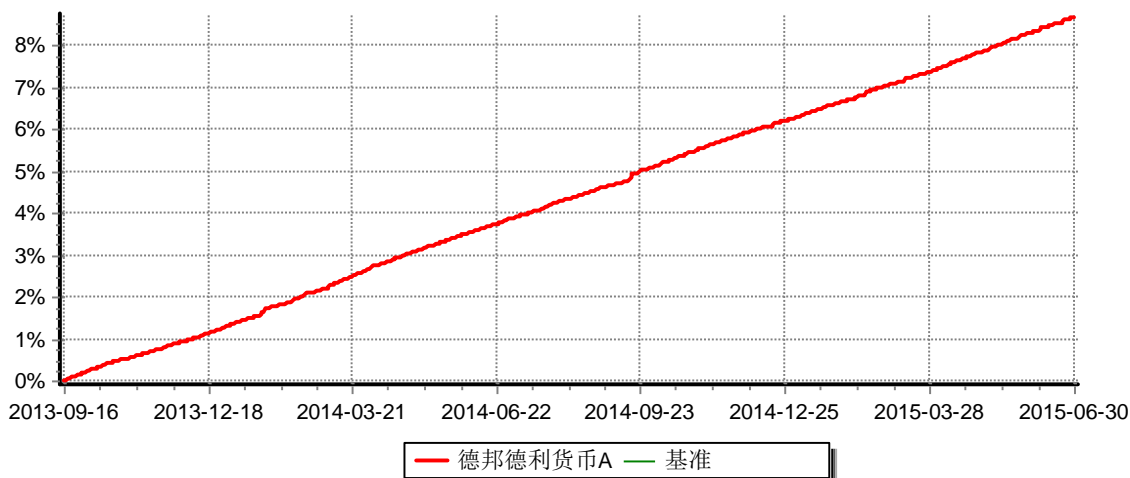
至今（2013年09月16日-2015年06月30日）						
-----------------------------	--	--	--	--	--	--

(2) 德邦德利货币B基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

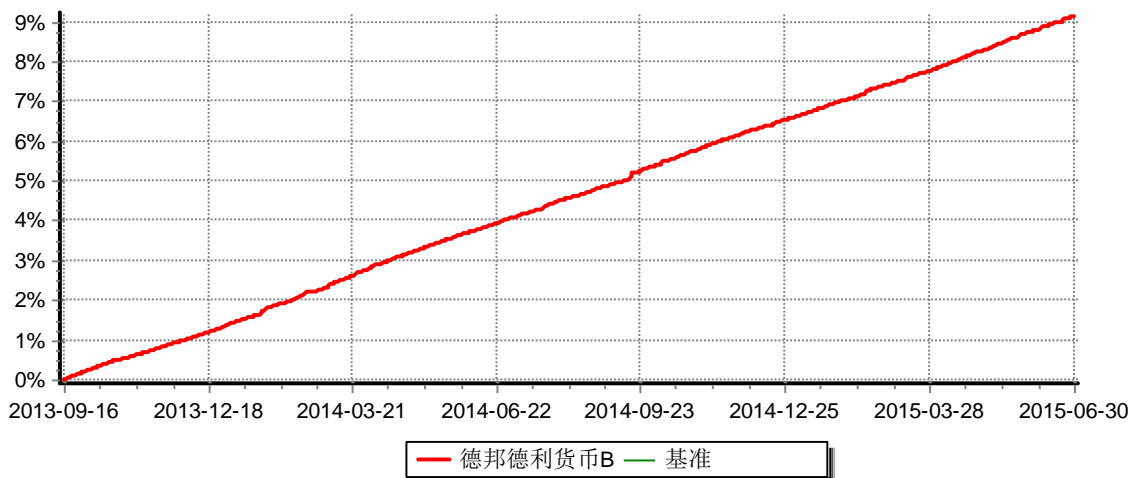
阶段(B级)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3815 %	0.0078 %	0.1110 %	0.0000 %	0.2705 %	0.0078 %
过去三个月	1.2320 %	0.0065 %	0.3366 %	0.0000 %	0.8954 %	0.0065 %
过去六个月	2.3798 %	0.0074 %	0.6695 %	0.0000 %	1.7103 %	0.0074 %
过去一年	4.8861 %	0.0080 %	1.3500 %	0.0000 %	3.5361 %	0.0080 %
自基金合同生效日起至今（2013年09月16日-2015年06月30日）	9.1250 %	0.0075 %	2.4115 %	0.0000 %	6.7135 %	0.0075 %

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

德邦德利货币市场基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年9月16日-2015年6月30日)



注：本基金的《基金合同》生效日为2013年9月16日，截至报告期末，基金合同已满1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。



注：本基金的《基金合同》生效日为2013年9月16日，截至报告期末，基金合同已满1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。

§ 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2015年6月30日，本基金管理人共管理九只开放式基金：德邦优化配置股票型证券投资基金、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、德邦新动力灵活配置混合型证券投资基金、德邦大健康灵活配置混合型证券投资基金、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金、德邦鑫星稳健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、德邦新添利灵活配置混合型证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯慧娣	固定收益部副总监、本基金的基金经理、德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金的基金经理。	2013年10月15日	2015年6月24日	5	理学硕士，约翰霍普金斯大学博士生候选人，历任世商软件有限公司债券分析师、国信证券经济研究所固定收益分析师。曾任固定收益部副总监、本基金的基金经理和德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金的基金经理。
何晶	固定收益部副总监、本基金的基金经理、德邦德信中证中高收益企债指数	2013年9月16日	—	5	哥伦比亚大学硕士。历任职江海证券数量分析,东证期货数量研究员、TNT数据库分析师、奥瑞高市场研究公司市场研究员。现任固定收益部副总监、本基金的基金经理、德邦德信中证中高收益企债指数分级证券投资基金的基金经理、德邦新动力灵活

	<p>分级证券投资基金的基金经理、德邦新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、德邦鑫星稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金的</p>				<p>配置混合型证券投资基金的基金经理、德邦鑫星稳健灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、德邦福鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、德邦鑫星价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、德邦新添利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	---

	基金经 理、德邦 新添利 灵活配 置混合 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合规守信情况的说明

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，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。本基金管理人未发现异常交易行为。

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

报告期内，债券市场在经济下行压力不改、通胀维持低位以及货币宽松超预期

的带动下，总体上表现良好，整体收益率较年初明显下行。从货币政策方面来看，1季度货币政策不及预期，实体经济和资金利率高企，经济基本面也疲弱不堪，2季度央行加大了政策逆周期调节力度，全面降准、降息，并通过公开市场操作引导资金利率下行，宽松幅度超出市场预期，使得市场资金面非常宽松，资金利率大幅下行。从宏观经济数据来看，上半年由于股市走牛以及地产销售回暖，抑制了经济快速下行态势，但是房地产销售回暖尚未带动投资回升，股市泡沫破灭也将使得金融业GDP遭受重大打击。此外，传统的产能过剩行业，如钢铁、煤炭、有色金属、造船等周期性行业，经营继续呈恶化趋势，产品价格持续下跌，财务杠杆依然高企，去产能任务仍旧严峻。7月PMI指数为50.0%，环比下降0.2个百分点。下半年，经济能否实现企稳尚需基建投资发力。从通胀数据来看，CPI上半年持续处于低位，虽然从6月开始在猪肉价格带动下有所反弹，但依然远低于全年3%的政策目标。随着政策放松，资金面逐步宽松，至5月中下旬，资金利率达到2季度最低点，后又随着半年度时间到来和股灾发生有所反弹，但整体上资金利率有大幅下行，其中6月底R007较年初下降超过280个BP。而各评级短期融资券的收益率在上半年也出现了大幅度的下行。在这种形势下，本基金在做好扎实的投资研究的基础上，上半年保持了相对较高的短期融资券的仓位，配置了优质的短期融资券资产，同时也良好的把握了短融收益率下行带来的资本利得收益的机会，在保证流动性以及安全性的基础上，获取了相对较高的组合收益率，为本基金持有人带来了良好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类基金份额净值收益率为2.2586%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。B类基金份额净值收益率为2.3798%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 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、产品与金融工程部、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验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.6 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。本报告期德邦德利货币A累计收益分配金额7090125.3元，德邦德利货币B累计收益分配金额44055545.56元。

§ 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

中国民生银行根据《德邦德利货币市场基金基金合同》和《德邦德利货币市场基金托管协议》，托管德邦德利货币市场基金（以下简称“德邦德利货币基金”）。本报告期，中国民生银行在德邦德利货币基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，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，按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人--德邦基金管理有限公司在德邦德利货币基金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关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，基金管理人--德邦基金管理有限公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由德邦德利货币基金管理人--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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：德邦德利货币市场基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	640,897,865.52	561,336,073.66
结算备付金		3,214,000.00	640,000.00
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	1,790,014,315.63	2,395,910,238.07
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		1,790,014,315.63	2,395,910,238.07
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	941,003,531.50	1,245,793,228.69
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	36,959,880.00	42,354,626.86
应收股利		—	—
应收申购款		29,893,992.70	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		3,441,983,585.35	4,246,034,167.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—

卖出回购金融资产款		—	419,936,770.09
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	25,000.00
应付管理人报酬		733,075.75	—
应付托管费		222,144.16	237,484.05
应付销售服务费		112,848.34	203,983.96
应付交易费用	6.4.7.7	106,244.64	70,287.39
应交税费		—	—
应付利息		—	53,005.00
应付利润		4,263,322.14	4,843,733.93
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	398,356.09	450,000.00
负债合计		5,835,991.12	425,820,264.42
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,436,147,594.23	3,820,213,902.86
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		3,436,147,594.23	3,820,213,902.86
负债和所有者权益总计		3,441,983,585.35	4,246,034,167.28

6.2 利润表

会计主体：德邦德利货币市场基金

本报告期：2015年1月1日-2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年1月1日 -2015年6月30日	上年度可比期间2014 年01月01日-2014年06 月30日
一、收入		59,004,884.96	12,243,758.50
1.利息收入		47,703,053.14	9,709,751.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,802,174.86	2,101,719.33
债券利息收入		31,987,083.85	5,683,721.06
资产支持证券利息收		—	—

入			
买入返售金融资产收入		2,913,794.43	1,924,310.78
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,301,831.82	2,534,007.33
其中：股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.12	11,301,831.82	2,534,007.33
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.13	—	—
股利收益		—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		—	—
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）		—	—
减：二、费用		7,859,334.10	1,773,399.91
1. 管理人报酬		3,621,531.99	700,191.27
2. 托管费		1,097,433.91	212,179.26
3. 销售服务费		491,124.00	138,131.21
4. 交易费用		—	—
5. 利息支出		2,415,178.11	432,009.54
其中：卖出回购金融资产支出		2,415,178.11	432,009.54
6. 其他费用	6.4.7.14	234,066.09	290,888.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		51,145,550.86	10,470,358.59
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”		51,145,550.86	10,470,358.59

号填列)			
------	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：德邦德利货币市场基金

本报告期：2015年1月1日-2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日-2015年6月30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)	3,820,213,902.86	—	3,820,213,902.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	51,145,670.86	51,145,670.86
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)	-384,066,308.63	—	-384,066,308.63
其中：1.基金申购款	7,532,826,712.82	—	7,532,826,712.82
2.基金赎回款	-7,916,893,021.45	—	-7,916,893,021.45
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)	—	-51,145,670.86	-51,145,670.86
五、期末所有者权益(基金净值)	3,436,147,594.23	—	3,436,147,594.23
项 目	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年06月30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)	451,597,689.80	—	451,597,689.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	10,470,358.59	10,470,358.59
三、本期基金份额交易产生的	461,400,753.17	—	461,400,753.17

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	2,022,452,048.46	—	2,022,452,048.46
2.基金赎回款	-1,561,051,295.29	—	-1,561,051,295.29
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)	—	-10,470,358.59	-10,470,358.59
五、期末所有者权益(基金净值)	912,998,442.97	—	912,998,442.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

德邦德利货币市场基金(以下简称“本基金”),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[2013]1018号文《关于核准德邦德利货币市场基金募集的批复》的核准,由基金管理人德邦基金管理有限公司于2013年9月2日至2013年9月12日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2013)验字60982868_B06号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年9月16日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币2,079,975,068.78元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币455,002.82元,以上实收基金(本息)合计为人民币2,080,430,071.60元,折合2,080,430,071.60份基金份额。本基金的基金管理人、注册登记机构均为德邦基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括:现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、短期融资券、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金在保持组合高度流动性的前提下,结合

对国内外宏观经济运行、金融市场运行、资金流动格局、货币市场收益率曲线形态等方面的分析，合理安排组合期限结构，积极选择投资工具，采取主动性的投资策略和精细化的操作手法，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2015年06月30日的财务状况以及2015年01月01日至2015年06月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，会计估计与最近一期年度报告不一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2015年01月01日起至2015年06月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

人民币

6.4.4.3 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

2) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定：自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	897,865.52
定期存款	640,000,000.00
合计	640,897,865.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	—	—	—	—

	银行间市场	1,790,014,315.6 3	1,795,146,500.0 0	5,132,184.37	0.1494%
	合计	1,790,014,315.6 3	1,795,146,500.0 0	5,132,184.37	0.1494%

注：注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本。 2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	941,003,531.50	—
合计	941,003,531.50	

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	10,692.16
应收定期存款利息	3,044,360.65
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	1,301.67
应收债券利息	33,430,489.61
应收买入返售证券利息	473,035.91
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	36,959,880.00

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	106,244.64
合计	106,244.64

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提审计费	89,752.78
预提信息披露费	308,603.31
合计	398,356.09

6.4.7.9 实收基金**6.4.7.9.1 德邦德利货币A**

金额单位：人民币元

项目(A级)	本期2015年1月1日-2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	484,381,938.63	484,381,938.63
本期申购	2,170,545,637.96	2,170,545,637.96
本期赎回(以“-”号填列)	-2,081,160,363.62	-2,081,160,363.62
本期末	573,767,212.97	573,767,212.97

6.4.7.9.2 德邦德利货币B

金额单位：人民币元

项目(B级)	本期2015年1月1日-2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,335,831,964.23	3,335,831,964.23

本期申购	5,362,281,074.86	5,362,281,074.86
本期赎回（以“-”号填列）	-5,835,732,657.83	-5,835,732,657.83
本期末	2,862,380,381.26	2,862,380,381.26

注：注：申购含红利再投、转换入和分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 德邦德利货币A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	7,090,125.30	—	7,090,125.30
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-7,090,125.30	—	-7,090,125.30
本期末	—	—	—

6.4.7.10.2 德邦德利货币B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	44,055,545.56	—	44,055,545.56
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-44,055,545.56	—	-44,055,545.56
本期末	—	—	—

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日
活期存款利息收入	152,928.33
定期存款利息收入	12,644,722.78
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	4,523.67
其他	0.08
合计	12,802,174.86

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年 06月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	11,301,831.82	2,534,007.33
债券投资收益——赎回差价 收入	—	—
债券投资收益——申购差价 收入	—	—
合计	11,301,831.82	2,534,007.33

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年01月01日-2014年 06月30日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	4,704,620,142.70	—
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	4,585,051,542.90	—
减：应收利息总额	108,266,767.98	—

买卖债券差价收入	11,301,831.82	2,534,007.33
----------	---------------	--------------

6.4.7.13 衍生工具收益

无余额。

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	168,603.31
银行汇划费用	22,010.00
债券帐户维护费	13,700.00
开户费	—
其他	—
合计	234,066.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
德邦基金管理有限公司（“德邦基金”）	基金管理人、基金销售机构
德邦证券股份有限公司（“德邦证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
西子联合控股有限公司	基金管理人的股东
浙江省土产畜产进出口集团有限公司	基金管理人的股东
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
德邦创新资本有限责任公司（“德邦创新资本”）	基金管理人的子公司

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
德邦基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
德邦证券股份有限公司(“德邦证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
德邦创新资本有限责任公司(“德邦创新资本”)	基金管理人的子公司
中国民生银行股份有限公司(“民生银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2015年1月1日-2015年6月30日		上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购总量的比例	成交金额	占当期债券回购总量的比例
德邦证券	832,800,000.00	100.00%	253,900,000.00	100.00%

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日	上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,621,531.99	700,191.27

其中：应支付销售机构的客户维护费	226,710.16	66,044.04
------------------	------------	-----------

注：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日	上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,097,433.91	212,179.26

注：日托管费=前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日-2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	德邦德利货币A	德邦德利货币B	合计
德邦基金	16,833.06	14,081.27	30,914.33
德邦证券	2,151.05	45.07	2,196.12
民生银行	79,260.51	1,165.49	80,426.00
合计	98,244.62	15,291.83	113,536.45

注：本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，对于由B类基金份额降级为A类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。B类基金份额的年销售服务费率为0.01%，对于由A类基金份额升级为B类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受B类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日		上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日	
	德邦德利货币A	德邦德利货币B	德邦德利货币A	德邦德利货币B
期初持有的基金份额	—	15,417,268.50	—	—
期间申购/买入总份额	4,121,548.77	24,386,038.01	41,979.94	22,081,563.54
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	-4,121,548.77	-19,599,747.69	-47,979.94	-15,039,583.60
期末持有的基金份额	—	20,203,558.82	—	7,041,979.94
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.71%	—	0.85%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称		本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
		持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
B类	德邦创新资本	85960707.73	2.51%	50079346.57	1.31%

注：德邦创新资本投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2015年1月1日-2015年6月30日		上年度可比期间2014年01月01日-2014年06月30日	
	期末余额	当期存款利息收入	期末余额	当期存款利息收入
中国民生银行股份有限公司-活期存款	897,865.52	152,928.33	70,102.01	48,238.99
中国民生银行股份有限公司-定期存款	60,000,000.00	3,546,556.80	60,000,000.00	480,510.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率计息。除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2015年01月01日至2015年06月30日止期间获得的利息收入为人民币4,522.32元，2015年06月30日结算备付金余额为人民币3,214,000元。

2014年01月01日至2014年06月30日止期间获得的利息收入为人民币2,065.70元，2014年06月30日结算备付金余额为人民币275,000.00元。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金(A级)	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
7,511,100.18	505,018.45	949,544.60	8,965,663.23	
已按再投资形式转实收基金(B级)	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
37,621,358.22	6,088,605.80	-18,355,522.85	25,354,441.17	

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.1.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年06月30日止，本基金无银行间市场债券正回购交易。

6.4.12.1.2 交易所市场债券正回购

本报告期末,本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理、全员风险管理，公司构建了分工明确、相互协作、彼此制约的风险管理组织架构体系。董事会负责公司整体经营风险的管理，对公司建立风险管理体系和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，协助董事会进行风险管理，风险管理委员会负责起草公司风险管理战略，审议、监督、检查、评估公司经营管理与受托投资的风险控制状况。经理层负责落实董事会拟定的风险管理政策，并对风险控制的有效执行承担责任。经理层下设风险控制委员会，协助经理层进行风险控制，风险控制委员会负责组织风险管理体系的建设，确定风险管理原则、目标和方法，审议风险管理制度和流程，指导重大风险事件的处理。督察长负责监督检查公司风险管理工作的执行情况，评价公司内部风险控制制度的合法性、合规性和有效性，并向董事会报告。风险管理部门为日常风险管理的执行部门，主要负责对公司经营管理和受托投资风险的预警和事中控制，对有关风险进行分析并向经理层汇报。公司各部门是风险控制措施的执行部门，负责识别和控制业务活动中潜在风险，做好风险的事先防范。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的

金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

根据本基金的信用风险控制要求，本基金投资的短期融资券的信用评级，不低于以下标准：

- 1)国内信用评级机构评定的A-1级或相当于A-1级的短期信用级别；
- 2)根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

- A. 国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的长期信用级别；
- B. 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别(例如，若中国主权评级为A-级，则低于中国主权评级一个级别的为BBB+级)。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国家政策性金融债及企业债等，均在证券交易所上市或可在银行间同业市场交易；因此本报告期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种,以摊余成本计价,并通过"影子定价"机制使摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值,因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金的生息资产主要包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2015年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	640,897,865.52	—	—	—	—	—	640,897,865.52
结算备付金	3,214,000.00	—	—	—	—	—	3,214,000.00
交易性金融资产	160,053,209.91	50,062,347.72	1,277,980,384.86	—	—	—	1,488,095,942.49
买入返售金融资产	941,003,531.50	—	—	—	—	—	941,003,531.50
应收利息	—	—	—	—	—	36,959,880.00	36,959,880.00
应收申购款	—	—	—	—	—	29,893,992.70	29,893,992.70
资产总计	1,745,168,606.93	50,062,347.72	1,277,980,384.86	—	—	66,853,872.70	3,140,065,212.21
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	733,075.75	733,075.75
应付托管费	—	—	—	—	—	222,144.16	222,144.16
应付销售服务费	—	—	—	—	—	112,848.34	112,848.34
应付交易费用	—	—	—	—	—	106,244.64	106,244.64
应付利润	—	—	—	—	—	4,263,322.14	4,263,322.14
其他负债	—	—	—	—	—	398,356.09	398,356.09
负债总计	—	—	—	—	—	5,835,991.12	5,835,991.12
利率敏感度缺口	1,745,168,606.93	50,062,347.72	1,277,980,384.86	—	—	61,017,881.58	3,134,229,221.09

上年度末 2014年12月 31日	1个月以 内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	176,336, 073.66	385,000, 000.00	—	—	—	—	561,336, 073.66
结算备付金	640,000. 00	—	—	—	—	—	640,000. 00
交易性金融 资产	230,075, 875.26	502,966, 137.04	1,662,86 8,225.77	—	—	—	2,395,91 0,238.07
买入返售金 融资产	1,245,79 3,228.69	—	—	—	—	—	1,245,79 3,228.69
应收利息	—	—	—	—	—	42,354,6 26.86	42,354,6 26.86
资产总计	1,652,84 5,177.61	887,966, 137.04	1,662,86 8,225.77	—	—	42,354,6 26.86	4,246,03 4,167.28
负债							
卖出回购金 融资产款	419,936, 770.09	—	—	—	—	—	419,936, 770.09
应付赎回款	—	—	—	—	—	25,000.0 0	25,000.0 0
应付托管费	—	—	—	—	—	237,484. 05	237,484. 05
应付销售服 务费	—	—	—	—	—	203,983. 96	203,983. 96
应付交易费 用	—	—	—	—	—	70,287.3 9	70,287.3 9
应付利息	—	—	—	—	—	53,005.0 0	53,005.0 0
应付利润	—	—	—	—	—	4,843,73 3.93	4,843,73 3.93
其他负债	—	—	—	—	—	450,000. 00	450,000. 00
负债总计	419,936,	—	—	—	—	5,883,49	425,820,

	770.09					4.33	264.42
利率敏感度	1,232,90	887,966,	1,662,86	—	—	36,471,1	3,820,21
缺口	8,407.52	137.04	8,225.77			32.53	3,902.86

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品,且以摊余成本进行后续计量,因此无重大其他市场价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	固定收益投资	1,790,014,315.63	52.01
	其中：债券	1,790,014,315.63	52.01
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	941,003,531.50	27.34
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	644,111,865.52	18.71
4	其他各项资产	66,853,872.70	1.94
5	合计	3,441,983,585.35	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	8.80	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中：买断式回购融资	—	—

注：1、报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值；

2、在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	150
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限 (天数)	原因	调整期
1	2015-01-27	121	大额赎回被动超标	十个交易日之内
2	2015-02-13	121	大额赎回被动超标	十个交易日之内
3	2015-02-16	121	大额赎回被动超标	十个交易日之内
4	2015-01-26	122	大额赎回被动超标	十个交易日之内
5	2015-01-22	122	大额赎回被动超标	十个交易日之内
6	2015-01-25	123	大额赎回被动超标	十个交易日之内

7	2015-01-08	124	大额赎回被动超标	十个交易日之内
8	2015-01-24	124	大额赎回被动超标	十个交易日之内
9	2015-01-23	125	大额赎回被动超标	十个交易日之内
10	2015-01-11	138	大额赎回被动超标	十个交易日之内
11	2015-01-10	139	大额赎回被动超标	十个交易日之内
12	2015-01-20	139	大额赎回被动超标	十个交易日之内
13	2015-01-09	140	大额赎回被动超标	十个交易日之内
14	2015-01-18	141	大额赎回被动超标	十个交易日之内
15	2015-01-17	142	大额赎回被动超标	十个交易日之内
16	2015-01-19	142	大额赎回被动超标	十个交易日之内
17	2015-01-16	143	大额赎回被动超标	十个交易日之内
18	2015-01-15	144	大额赎回被动超标	十个交易日之内
19	2015-01-14	144	大额赎回被动超标	十个交易日之内
20	2015-01-13	149	大额赎回被动超标	十个交易日之内
21	2015-01-12	150	大额赎回被动超标	十个交易日之内

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”，本报告期内本基金发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况详见上表。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	52.82	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.45	—
2	30天(含)—60天	0.58	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	7.63	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.71	—
4	90天(含)—180天	26.70	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)—397天(含)	10.49	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	98.22	—

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	392,359,068.74	11.42
	其中：政策性金融债	392,359,068.74	11.42
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	1,397,655,246.89	40.68
6	中期票据	—	—

7	其他	—	—
8	合计	1,790,014,315.63	52.09
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	211,718,816.09	6.16

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净值 比例 (%)
1	130250	13国开50	1,000,000	101,489,787.88	2.95
2	0414590 67	14安钢集 CP002	1,000,000	100,546,592.18	2.93
3	0414560 53	14陕交建 CP002	1,000,000	100,058,635.70	2.91
4	0414520 52	14华信石油	900,000	90,602,024.83	2.64
5	0115991 94	15亚泰SCP002	900,000	89,995,146.59	2.62
6	0414650 09	14株高科 CP002	800,000	80,030,408.34	2.33
7	100236	10国开36	700,000	70,225,123.73	2.04
8	130241	13国开41	600,000	60,296,036.87	1.75
9	0414601 06	14海沧投资 CP002	600,000	60,206,816.10	1.75
10	0414540 72	14东明石化 CP001	500,000	50,304,349.16	1.46

7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	54
报告期内偏离度的最高值	0.5491%
报告期内偏离度的最低值	-0.0304%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1871%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 投资组合报告附注**7.8.1 基金计价方法说明。**

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

7.8.2 报告期内，本基金不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

7.8.3 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受到公开谴责、处罚的情形。

7.8.4 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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	36,959,880.00
4	应收申购款	29,893,992.70
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	66,853,872.70

§ 8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额 级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有 份额	占总份 额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
德邦德利货币 A	9,725	58,999.20	11,353,959. 84	1.98%	562,413,253 .13	98.02%
德邦德利货币 B	68	42,093,829. 14	2,627,586,1 24.57	91.80%	234,794,256 .69	8.20%
合计	9,793	350,877.93	2,638,940,0 84.41	76.80%	797,207,509 .82	23.20%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人 员持有本基金	德邦德利货 币A	2,052,817.27	0.36%
	德邦德利货 币B	—	—
	合计	2,052,817.27	0.059%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投 资和研究部门负责人持有本 开放式基金	德邦德利货 币A	50~100
	德邦德利货 币B	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放 式基金	德邦德利货 币A	0~10
	德邦德利货 币B	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	德邦德利货币A	德邦德利货币B
基金合同生效日(2013年9月16日)基金份额总额	1,422,469,897.34	657,960,174.26
本报告期期初基金份额总额	484,381,938.63	3,335,831,964.23
本报告期基金总申购份额	2,170,545,637.96	5,362,281,074.86
减：本报告期基金总赎回份额	2,081,160,363.62	5,835,732,657.83
本报告期期末基金份额总额	573,767,212.97	2,862,380,381.26

注：申购含红利再投、转换入及分级份额调增份额；赎回含转换出及分级份额调减份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人2015年6月25日发布公告，侯慧娣不再担任德邦德利货币市场基金的基金经理。

(2) 本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自基金合同生效日（2013年9月16日）起至本报告期末，向本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券成交金额	债券交易占当期成交总额的比例	债券回购成交金额	债券回购交易占当期成交总额的比例	权证交易成交金额	权证交易占当期成交总额的比例	应支付券商的佣金	应支付券商的佣金占当期佣金总量的比例	备注
德邦证券	1	—	—	832,800,000.00	100.00%	—	—	—	—	0

注：1、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司管理层批准。

基本选择标准：

- （一）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
- （二）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- （三）经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到行政处罚；
- （四）近两年未发生就交易席位方面的违约、侵权等各种纠纷；
- （五）内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足投资组合资产运作高度保密的要求；
- （六）具备投资组合资产运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理投资组合资产进行证券交易的要求，并能为投资组合资产提供全面的信息服务；
- （七）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为公司提供高质量的咨询服务；
- （八）对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

券商选择程序：

- （一）公司投资研究部按照投资研究部按照上一节中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；
- （二）对通过初选的各家券商，投资研究部员工在其分管行业或领域内，对该机构所提供的研究报告、信息资讯和服务进行评分；参加券商选择评分的人员为公司投资研究部相关人员；
- （三）投资研究部员工评分后，汇总得出各家券商的综合评分；
- （四）投资研究部将对券商的综合评分结果上报公司管理层；
- （五）公司管理层最终确定要选用其专用席位的券商；
- （六）公司管理层确定并下文后，由交易部等相关部门配合完成专用席位的具体租用事宜。

2、本报告期内，本基金租用证券公司的交易单元无变更。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

项目	发生日期	偏离度	法定披露报刊	法定披露日期
报告期内偏离度绝对值在0.5%（含）以上	2015-05-14	0.005491	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-05-16
报告期内偏离度绝对值在0.5%（含）以上	2015-05-15	0.00524	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-05-17

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	德邦基金管理有限公司关于增加代销机构、开通定期定额申购业务、基金转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-01-05
2	德邦德利货币市场基金2014年第四季度报告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-01-21
3	德邦德利货币市场基金“春节”假期前暂停申购、转换转入及定期定额申购业务的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-02-12
4	德邦基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-03-27
5	德邦德利货币市场基金2014年年度报告及其摘要	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-03-28
6	德邦基金管理有限公司关于网站系统维护升级的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-04-02
7	德邦基金管理有限公司关于增加	中国证监会指定媒体及公	2015-04-15

	上海大智慧股份有限公司 为代销机构和参加费率优惠活动的公告	司网站	
8	德邦德利货币市场基金2015年第1季度报告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-04-20
9	德邦德利货币市场基金暂停大额申购（含转换转入及定期定额申购）业务的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-04-21
10	德邦德利货币市场基金关于调整大额申购(含转换转入及定期定额申购)业务限制金额的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-04-28
11	德邦德利货币市场基金更新招募说明书及其摘要（2015年第1号）	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-04-28
12	关于德邦基金管理有限公司增加代销机构、开通定期定额申购业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-05-15
13	德邦德利货币市场基金偏离度绝对值超过0.5%公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-05-16
14	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金开通基金转换业务及在直销渠道和部分代销机构参加转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-05-18
15	德邦德利货币市场基金偏离度绝对值超过0.5%公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-05-19
16	关于德邦鑫星稳健基金在直销渠道开通基金转换业务、定期定额申购业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-05-27
17	德邦基金管理有限公司关于旗下基金增加天天基金为代销机构、开通定期定额申购业务、基金转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-05-29

18	德邦基金管理有限公司关于旗下基金增加国泰君安证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额申购业务、基金转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-06-01
19	德邦德利货币市场基金恢复大额申购(含转换转入及定期定额申购)业务的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-06-25
20	德邦基金管理有限公司旗下开放式基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2015-06-26

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、德邦德利货币市场基金基金合同；
- 3、德邦德利货币市场基金托管协议；
- 4、德邦德利货币市场基金招募说明书；
- 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。

11.2 存放地点

上海市虹口区吴淞路218号宝矿国际大厦35层。

11.3 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。

德邦基金管理有限公司

二〇一五年八月二十七日