

德邦德利货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 24 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 2017 年 8 月 23 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 债券回购融资情况.....	45
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	46
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	47
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.9 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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的情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	54
10.9 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	56
备查文件目录.....	57
11.2 备查文件目录.....	57

11.3 存放地点.....	57
11.4 查阅方式.....	57

§ 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	4,078,438,047.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
下属分级基金的交易代码:	000300	000301
报告期末下属分级基金的份额总额	124,389,379.92 份	3,954,048,667.69 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	罗菲菲
	联系电话	021-26010999	010-58560666
	电子邮箱	service@dbfund.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008217788	95568
传真		021-26010808	010-58560798
注册地址		上海市虹口区吴淞路 218 号	北京市西城区复兴门内大街 2

	宝矿国际大厦 35 层	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	洪崎

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
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
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

§ 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

基金级别	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2, 199, 334. 60	105, 539, 821. 49
本期利润	2, 199, 334. 60	105, 539, 821. 49
本期净值收益率	1. 6665%	1. 7878%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	124, 389, 379. 92	3, 954, 048, 667. 69
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(2017 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	14. 6911%	15. 7406%

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 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

德邦德利货币 A

阶段	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. 3161%	0. 0023%	0. 1110%	0. 0000%	0. 2051%	0. 0023%
过去三个月	0. 9134%	0. 0015%	0. 3366%	0. 0000%	0. 5768%	0. 0015%
过去六个月	1. 6665%	0. 0023%	0. 6695%	0. 0000%	0. 9970%	0. 0023%
过去一年	2. 8803%	0. 0028%	1. 3500%	0. 0000%	1. 5303%	0. 0028%
自基金合同生效起至今	14. 6911%	0. 0061%	5. 1189%	0. 0000%	9. 5722%	0. 0061%

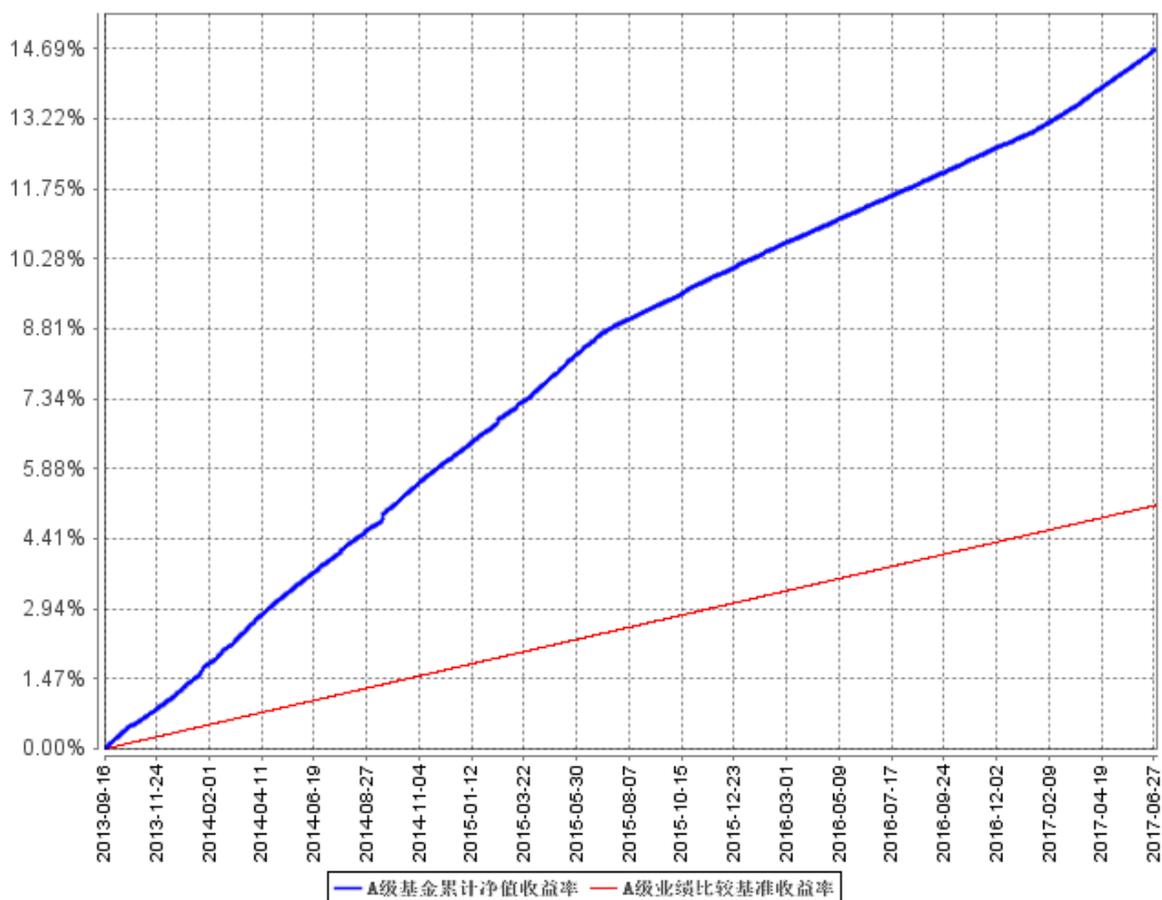
德邦德利货币 B

阶段	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	0.3359%	0.0023%	0.1110%	0.0000%	0.2249%	0.0023%
过去三个月	0.9738%	0.0015%	0.3366%	0.0000%	0.6372%	0.0015%
过去六个月	1.7878%	0.0023%	0.6695%	0.0000%	1.1183%	0.0023%
过去一年	3.1275%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	1.7775%	0.0028%
自基金合同 生效起至今	15.7406%	0.0061%	5.1189%	0.0000%	10.6217%	0.0061%

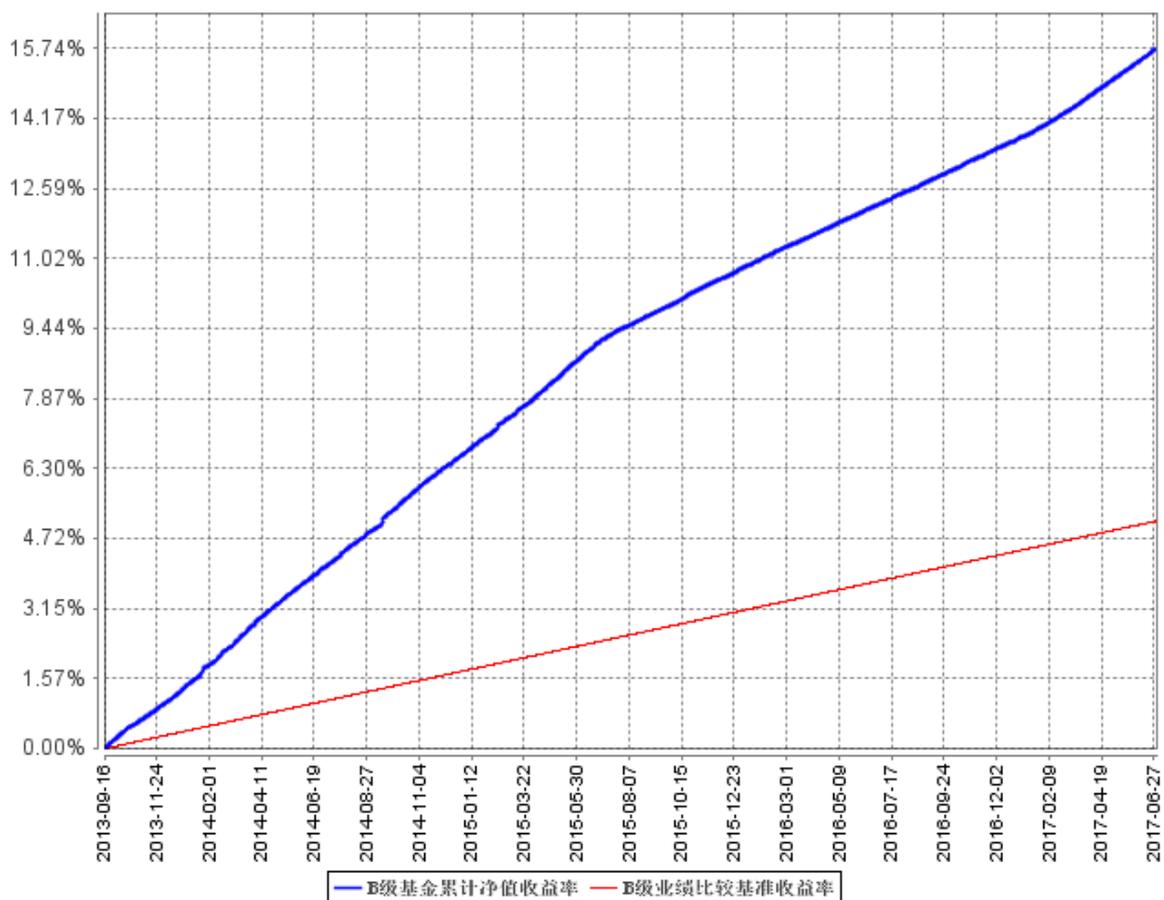
注：本基金的业绩比较基准为七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2013 年 9 月 16 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满 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。图示日期为 2013 年 9 月 16 日至 2017 年 6 月 30 日。

§ 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2017年6月30日，本基金管理人共管理二十四只开放式基金：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证券投资基金（LOF）、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、德邦新添利债券型证券投资基金、德邦新回报灵活配置混合型证券投资基金、德邦锐乾债券型证券投资基金、德邦群利债券型证券投资基金、德邦稳盈增长灵活配置混合型证券投资基金、德邦量化优选股票型证券投资基金（LOF）和德邦锐祺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		
张铮烁	固定收益部总监助理、本基金的基金经理、德邦德信中证中高收益企债指数证券投资基金	2016年1月8日	-	9年	硕士，2007年7月至2010年7月在中诚信国际信用评级有限责任公司评级部担任分析师、项目经理，2010年8月至2015年5月在安邦资产管理有限责任公司固定收益部担任投资经理。2015年11月加入德邦基金管理有限公司，现任本公司固定收益部总监助

	(LOF)、 德邦如意 货币市场 基金、德 邦增利货 币市场基 金、德邦 现金宝交 易型货币 市 场 基 金、德邦 纯债 9 个 月定期开 放债券型 证券投资 基金的基 金经理。				理、基金经理。
陈利	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、德邦 纯 债 18 个月定期 开放债券 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、 德邦现金 宝交易型 货币市场 基金的基 金经理。	2015年7月6日	2017年1月13 日	5年	硕士，曾在德邦证券股份有 限公司投资研究部担任助 理研究员。曾任本公司投资 研究部研究员、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，并对连续连两个季度期间内、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。

4.3.2 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，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

一季度，央行实施中性稳健货币政策，货币市场呈现紧平衡态势，资金利率中枢进一步抬升。

央行上调 MLF 及 OMO 利率，指导金融机构去杠杆意图明显。受 1 月份春节因素及缴税影响以及 3 月份受大行转债和 MPA、LCR 季末考核影响，呈现资金利率阶段性飙升态势。二季度，经济走势稳健，随着大宗商品价格持续下行，PPI 见顶回落，CPI 食品降幅缩窄，非食品温和上涨。央行继续实施稳健中性的货币政策，金融去杠杆相关的监管政策频出，市场情绪谨慎，货币市场呈现紧平衡态势，资金利率中枢进一步抬升。但随着 5 月银行理财增速下滑，同业存单存量在 4 月末达到高点后亦有所下滑，M2 增速明显下行，金融去杠杆取得阶段性成果。货币政策削峰填谷平稳流动性，使得 6 月流动性总量较为宽裕，资金利率下滑，同业存单发行利率在 6 月上旬达到高点后亦快速下滑。

报告期内，本基金严格遵守货币基金相关法律法规，保持较为稳健的投资风格，按照法律法规所规定的品种、久期、杠杆比例等要求进行投资操作，并严格把控信用风险，优选投资标的。同时，本基金密切跟踪经济基本面、政策面、资金面等情形，做好组合投资安排，在月末、季末、年末等时点，提前预备充足的流动性，做好基金的流动性管理，努力为投资人赚取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期德邦德利货币 A 的基金份额净值收益率为 1.6665%，本报告期德邦德利货币 B 的基金份额净值收益率为 1.7878%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看，后续国内经济在边际上有走弱的趋势，但仍有韧性，年内通胀亦将保持温和。货币政策方面，在金融去杠杆已经取得初步成果的背景下，货币政策边际上已有所放松，但是金融去杠杆尚未完成，美欧货币政策趋紧也会对国内造成一定压力，货币政策预计仍将维持稳健中性。一方面，去杠杆取得阶段性成果和中期经济下行压力较大，意味着收益率上行空间有限；另一方面，经济增长仍然有一定的韧性，在金融去杠杆持续推进的背景下，货币政策也很难掉头转向明显宽松。因此，预计下半年债券市场仍将保持震荡行情。

4.6 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验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 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。本报告期内，德邦德利 A 实施利润分配金额为 2,199,334.60 元，德邦德利 B 实施利润分配的金额为 105,539,821.49 元。

4.8 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

无。

§ 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关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，德邦德利 A 实施利润分配金额为 2,199,334.60 元，德邦德利 B 实施利润分配的金额为 105,539,821.49 元。

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半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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,475,292,958.92	1,932,803,634.75
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,391,611,365.13	4,039,396,184.19
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,379,526,131.98	4,034,351,638.18
资产支持证券投资		12,085,233.15	5,044,546.01
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	200,230,980.34	2,901,572,192.36
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	16,364,973.35	38,869,715.11
应收股利		-	-
应收申购款		3,822,594.25	24,308,018.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,087,322,871.99	8,936,949,744.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,489,263.32	2,684,918.01
应付托管费		451,291.93	813,611.49
应付销售服务费		68,300.87	122,251.27
应付交易费用	6.4.7.7	54,354.54	165,347.11

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		6,312,846.20	6,780,507.14
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	508,767.52	560,000.00
负债合计		8,884,824.38	11,126,635.02
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,078,438,047.61	8,925,823,109.80
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,078,438,047.61	8,925,823,109.80
负债和所有者权益总计		4,087,322,871.99	8,936,949,744.82

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，德邦德利货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 124389379.92 份；德邦德利货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3954048667.69 份。德邦德利货币份额总额合计为 4078438047.61 份。

6.2 利润表

会计主体：德邦德利货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017 年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年6月30日
一、收入		122,590,169.06	200,736,402.17
1.利息收入		122,713,995.00	198,506,234.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,868,430.74	61,830,753.70
债券利息收入		48,445,626.06	100,987,426.99
资产支持证券利息收入		228,514.51	-
买入返售金融资产收入		24,171,423.69	35,688,054.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-123,825.94	2,230,167.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-125,115.52	2,230,167.46
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	1,289.58	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
减: 二、费用		14,851,012.97	30,062,888.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,066,455.40	21,793,790.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,050,441.05	6,604,178.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	466,317.98	903,134.21
4. 交易费用	6.4.7.19	50.00	-889.50
5. 利息支出		1,054,629.17	544,171.52
其中: 卖出回购金融资产支出		1,054,629.17	544,171.52
6. 其他费用	6.4.7.20	213,119.37	218,502.88
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		107,739,156.09	170,673,513.61
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		107,739,156.09	170,673,513.61

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: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	8,925,823,109.80	-	8,925,823,109.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	107,739,156.09	107,739,156.09
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)	-4,847,385,062.19	-	-4,847,385,062.19
其中: 1. 基金申购款	18,815,195,604.51	-	18,815,195,604.51
2. 基金赎回款	-23,662,580,666.70	-	-23,662,580,666.70
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)	-	-107,739,156.09	-107,739,156.09

五、期末所有者权益(基金净值)	4,078,438,047.61	0.00	4,078,438,047.61
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	15,830,374,877.88	-	15,830,374,877.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	170,673,513.61	170,673,513.61
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)	-4,508,077,091.70	-	-4,508,077,091.70
其中：1. 基金申购款	36,026,021,099.53	-	36,026,021,099.53
2. 基金赎回款	-40,534,098,191.23	-	-40,534,098,191.23
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)	-	-170,673,513.61	-170,673,513.61
五、期末所有者权益(基金净值)	11,322,297,786.18	0.00	11,322,297,786.18

注：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向社会公开募集,基金合同于 2013 年 9 月 16 日正式生效,首次设立募集规模为 2,080,430,071.60 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、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。

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、1 年以内（含 1 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 1 年以内（含 1 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。

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（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，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〉》、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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易性金融资产及贷款和应收款项。本基金持有的交易性金融资产主要包括债券投资和资产支持证券投资等。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平

均法结转。

(2) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

(3) 资产支持证券投资

买入的资产支持证券于成交日确认为资产支持证券投资。资产支持证券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含的资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成资产支持证券投资成本；

卖出的资产支持证券于成交日确认资产支持证券投资收益。出售资产支持证券的成本按移动加权平均法结转；

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

1) 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

2) 债券投资

本基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

3) 资产支持证券投资

本基金持有的资产支持证券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

4) 回购协议

(1) 本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 本基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

(3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面

已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率逐日计提；

(3) 对于 A 类基金份额，基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；对于 B 类基金份额，基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01%的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

- (1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- (3) “每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；
- (4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
- (5) 本基金收益每月集中支付一次，成立不满一个月不支付。本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；
- (6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；
- (7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利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 2017年6月30日
活期存款	292,958.92
定期存款	1,475,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计：	1,475,292,958.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017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	2,379,526,131.98	2,381,452,000.00	1,925,868.02	0.0472%
	合计	2,379,526,131.98	2,381,452,000.00	1,925,868.02	0.0472%
资产支持证券	银行间市场	12,085,233.15	12,068,000.00	-17,233.15	-0.0004%
合计		2,391,611,365.13	2,393,520,000.00	1,908,634.87	0.0468%

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	200,230,980.34	-
合计	200,230,980.34	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	3,741.76
应收定期存款利息	4,642,621.09
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	11,667,636.64
应收买入返售证券利息	45,570.82
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	5,403.04
合计	16,364,973.35

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017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	54,354.54
合计	54,354.54

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017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	419,014.74
合计	508,767.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

德邦德利货币 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	171,026,400.87	171,026,400.87
本期申购	466,844,556.74	466,844,556.74
本期赎回(以“-”号填列)	-513,481,577.69	-513,481,577.69
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	124,389,379.92	124,389,379.92

金额单位：人民币元

德邦德利货币 B		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,754,796,708.93	8,754,796,708.93
本期申购	18,348,351,047.77	18,348,351,047.77
本期赎回(以“-”号填列)	-23,149,099,089.01	-23,149,099,089.01
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	3,954,048,667.69	3,954,048,667.69
-----	------------------	------------------

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

单位：人民币元

德邦德利货币 A			
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	2,199,334.60	-	2,199,334.60
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	-2,199,334.60	-	-2,199,334.60
本期末	-	-	-

单位：人民币元

德邦德利货币 B			
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	105,539,821.49	-	105,539,821.49
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	-105,539,821.49	-	-105,539,821.49
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	42,528.91
定期存款利息收入	49,825,901.83
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	49,868,430.74

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6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	-125,115.52
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	-125,115.52

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,599,198,396.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,549,578,839.88
减：应收利息总额	49,744,672.63
买卖债券差价收入	-125,115.52

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	12,964,768.99
减：卖出资产支持证券成本总额	12,960,000.00

减：应收利息总额	184,441.49
资产支持证券投资收益	1,289.58

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	50.00
合计	50.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	119,014.74
银行汇划费用	27,312.00
债券帐户维护费	36,500.00
其他	539.85
合计	213,119.37

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，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

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（“德邦基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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
德邦证券股份有限公司（“德邦证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,066,455.40	21,793,790.49
其中：支付销售机构的客户维护费	94,601.37	234,674.94

注：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33% / 当年天数。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,050,441.05	6,604,178.96

注：日托管费=前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 2017年1月1日至2017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	45,708.66	294,926.19	340,634.85
德邦证券	368.45	-	368.45
民生银行	117,434.87	1,387.30	118,822.17
合计	163,511.98	296,313.49	459,825.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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	50,657.01	631,936.51	682,593.52
德邦证券	475.32	-	475.32
民生银行	191,738.17	2,014.32	193,752.49
合计	242,870.50	633,950.83	876,821.33

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

注：本基金本报告期末及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	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）持有的基金份额	-	-

期初持有的基金份额	-	20,000,000.00
期间申购/买入总份额	13,893,250.48	38,055,917.33
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-13,893,250.48	-49,393,250.48
期末持有的基金份额	-	8,662,666.85
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.2100%

项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	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）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	19,757,746.53
期间申购/买入总份额	468,900.00	60,874,284.97
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-468,900.00	-36,968,900.00
期末持有的基金份额	-	43,663,131.50
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.3900%

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

德邦德利货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016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
德邦创新资本有限责任公司	30,000,000.00	0.7400%	-	0.0000%
德邦证券股份有限公司	22,829,331.19	0.5600%	26,033,896.55	0.2900%

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	292,958.92	42,528.79	1,082,972.64	40,114.38

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，2017年01月01日至2017年06月30日止期间获得的利息收入为人民币0元，2017年06月30日结算备付金余额为人民币0元。2016年01月01日至2016年06月30日止期间获得的利息收入为人民币0元，2016年06月30日结算备付金余额为人民币0元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末未发生其它关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

德邦德利货币A

已按再投资形式转实收基金	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
4,682,679.43	113,396.81	258,796.48	5,054,872.72	-

德邦德利货币B

已按再投资形式转实收基金	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
93,205,402.04	13,285,550.76	-726,457.42	105,764,495.38	-

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

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。监察稽核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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

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；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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	39,977,611.16	409,893,456.35
A-1 以下	-	-
未评级	2,039,203,490.67	3,269,342,628.98
合计	2,079,181,101.83	3,679,236,085.33

注：未评级债券为超短期融资券、国债、同业存单和政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	20,238,620.40	-
AAA 以下	-	50,393,257.44
未评级	280,106,409.75	304,722,295.41
合计	300,345,030.15	355,115,552.85

注：未评级债券为政策金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在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超短期融资券等，均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因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”机制使按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、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 2017 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	200,292,958.92	1,175,000,000.00	100,000,000.00	-	-	-	1,475,292,958.92

交易性金融资产	701,704,851.07	1,130,155,237.53	559,751,276.53	-	-	-	2,391,611,365.13
买入返售金融资产	200,230,980.34	-	-	-	-	-	200,230,980.34
应收利息	-	-	-	-	-	16,364,973.35	16,364,973.35
应收申购款	-	-	-	-	-	3,822,594.25	3,822,594.25
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,102,228,790.33	2,305,155,237.53	659,751,276.53	-	-	20,187,567.60	4,087,322,871.99
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,489,263.32	1,489,263.32
应付托管费	-	-	-	-	-	451,291.93	451,291.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-	68,300.87	68,300.87
应付交易费用	-	-	-	-	-	54,354.54	54,354.54
应付利润	-	-	-	-	-	6,312,846.20	6,312,846.20
其他负债	-	-	-	-	-	508,767.52	508,767.52
负债总计	-	-	-	-	-	8,884,824.38	8,884,824.38
利率敏感度缺口	1,102,228,790.33	2,305,155,237.53	659,751,276.53	-	-	11,302,743.22	4,078,438,047.61
上年度末 2016 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	1,532,803,634.75	400,000,000.00	-	-	-	-	1,932,803,634.75
交易性金融资产	699,457,941.85	1,570,746,272.00	1,769,191,970.34	-	-	-	4,039,396,184.19
买入返售金融资产	2,901,572,192.36	-	-	-	-	-	2,901,572,192.36
应收利息	-	-	-	-	-	38,869,715.11	38,869,715.11
应收申购款	-	-	-	-	-	24,308,018.41	24,308,018.41
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,133,833,768.96	1,970,746,272.00	1,769,191,970.34	-	-	63,177,733.52	8,936,949,744.82
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,684,918.01	2,684,918.01
应付托管费	-	-	-	-	-	813,611.49	813,611.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	122,251.27	122,251.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	165,347.11	165,347.11
应付利润	-	-	-	-	-	6,780,507.14	6,780,507.14
其他负债	-	-	-	-	-	560,000.00	560,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	11,126,635.02	11,126,635.02
利率敏感度缺口	5,133,833,768.96	1,970,746,272.00	1,769,191,970.34	-	-	52,051,098.50	8,925,823,109.80

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；

	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	基准利率减少 25 个基点	1,286,490.61	2,863,956.03
	基准利率增加 25 个基点	-1,284,162.26	-2,858,560.90

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，因此无重大其他价格风险。

§ 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	2,391,611,365.13	58.51
	其中:债券	2,379,526,131.98	58.22
	资产支持证券	12,085,233.15	0.30
2	买入返售金融资产	200,230,980.34	4.90
	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	1,475,292,958.92	36.09
4	其他各项资产	20,187,567.60	0.49
5	合计	4,087,322,871.99	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	1.11	
	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: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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注: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	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

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	26.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	15.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	40.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	2.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	13.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.72	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内，本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

7.5 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	109,682,601.72	2.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	280,106,409.75	6.87
	其中：政策性金融债	280,106,409.75	6.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	289,911,086.76	7.11
6	中期票据	20,238,620.40	0.50
7	同业存单	1,679,587,413.35	41.18
8	其他	-	-
9	合计	2,379,526,131.98	58.34
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	120233	12 国开 33	1,500,000	150,033,911.18	3.68
2	111793317	17 龙江银行 CD065	1,500,000	148,652,429.05	3.64
3	140438	14 农发 38	1,300,000	130,072,498.57	3.19
4	111780114	17 乌鲁木齐银行 CD027	1,000,000	98,920,907.94	2.43
5	111780006	17 珠海农商行 CD021	1,000,000	98,911,884.42	2.43
6	111780225	17 上海农商银行 CD144	1,000,000	98,911,117.90	2.43
7	111713048	17 浙商银行 CD048	1,000,000	97,789,683.72	2.40
8	111793871	17 南京银行 CD052	1,000,000	96,935,223.77	2.38
9	111799929	17 宁波银行 CD109	700,000	69,256,797.71	1.70
10	111709159	17 浦发银行 CD159	600,000	59,856,300.28	1.47

7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0468%
报告期内偏离度的最低值	-0.0653%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0130%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1789045	17 上和 1A1(总价)	200,000.00	12,085,233.15	0.30

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

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。

7.9.3 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	16,364,973.35
4	应收申购款	3,822,594.25
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,187,567.60

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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	6,608	18,824.06	24,256,227.04	19.50%	100,133,152.88	80.50%
德邦德利货币 B	47	84,128,695.06	3,946,268,569.57	99.80%	7,780,098.12	0.20%
合计	6,655	612,838.17	3,970,524,796.61	97.35%	107,913,251.00	2.65%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	德邦德利货币 A	2,637,174.97	2.1201%
	德邦德利货币 B	0.00	0.0000%
	合计	2,637,174.97	0.0647%

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的情况

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	>100
	德邦德利货币 B	0
	合计	>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	171,026,400.87	8,754,796,708.93
本报告期基金总申购份额	466,844,556.74	18,348,351,047.77
减：本报告期基金总赎回份额	513,481,577.69	23,149,099,089.01
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	124,389,379.92	3,954,048,667.69

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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期内无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项。

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

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自基金合同生效日起至本报告期末，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稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

本报告期内，由于对下属机构管控原因，中国证监会上海监管局对基金管理人相关高级管理人员采取出具警示函的监督管理措施，相关高级管理人员已积极进行整改。除上述内容外，基金管理人及其他高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：1、公司选择基金专用交易席位的基本选择标准：

- （一）注册资本不低于 1 亿元人民币；
- （二）财务状况良好，各项风险监控指标符合证监会的相关规定；
- （三）经营行为规范，未就交易单元发生违约或侵权行为；
- （四）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；
- （五）具备高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理各投资组合进行证券交易的需要；
- （六）研究实力较强，能根据需求提供质量较高的研究报告，以及相应的信息咨询服务；
- （七）收取的佣金费率合理。

公司按如下流程选择租用交易单元的证券公司：

- （一）研究部按照上述选择标准对证券公司进行初步筛选，经投资总监批准后提请总经理审批；
- （二）交易部办理相关交易单元，信息技术部、基金事务部和监察稽核部等相关部门配合完成交易单元租用的技术准备、参数调整及合同签订并及时通知各投资组合的托管机构等事宜。

2、本报告期内，本基金新增租用广发证券的交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例

德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期无使用证券公司交易单元的情况。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内本基金未有偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	德邦基金管理有限公司关于旗下证券投资基金 2016 年 12 月 31 日基金资产净值和基金份额净值的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017 年 1 月 1 日
2	德邦基金管理有限公司关于开通上海银行直销银行“上行快线”平台办理相关业务的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017 年 1 月 5 日
3	德邦基金管理有限公司关于开通徽商银行直销银行徽常有财平台办理相关业务的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017 年 1 月 11 日
4	德邦德利货币市场基金 2016 年 第 4 季度报告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017 年 1 月 20 日
5	德邦德利货币市场基金关于 2017 年“春节”假期前暂停大额申购（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	2017 年 1 月 24 日
6	德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017 年 2 月 23 日
7	德邦基金管理有限公司关于开通直销中心货币基金“德邦机构快线”增值服务的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017 年 2 月 25 日
8	德邦基金管理有限公司关于旗下基金增加大通证券为代销机构并开通基金转换业务的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017 年 3 月 1 日

9	德邦基金管理有限公司关于旗下基金增加济安财富为代销机构并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	2017年3月24日
10	德邦德利货币市场基金 2016 年度报告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017年3月27日
11	德邦德利货币市场基金 2016 年度报告摘要	中国证监会指定媒体及公司网站	2017年3月27日
12	德邦基金管理有限公司关于旗下基金增加东莞证券为代销机构并开通定期定额申购业务、基金转换业务的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017年4月7日
13	德邦德利货币市场基金 2017 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017年4月22日
14	德邦基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017年4月22日
15	德邦德利货币市场基金更新招募说明书及摘要（2017 年第 1 号）	中国证监会指定媒体及公司网站	2017年4月28日
16	德邦德利货币市场基金关于 2017 年“端午节”假期前暂停大额申购（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	2017年5月23日
17	德邦基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道开通基金转换业务并开展相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体及公司网站	2017年6月24日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

备查文件目录

11.2 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。

11.3 存放地点

上海市虹口区吴淞路 218 号宝矿国际大厦 35 层。

11.4 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。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-821-7788

德邦基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日