

# 德邦现金宝交易型货币市场基金 清算报告

基金管理人：德邦基金管理有限公司  
基金托管人：国泰君安证券股份有限公司  
清算报告公告日：2018年5月7日

## 一、重要提示

德邦现金宝交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）由德邦基金管理有限公司担任基金管理人，由国泰君安证券股份有限公司担任基金托管人，本基金根据 2016 年 06 月 12 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予德邦现金宝交易型货币市场基金注册的批复》（证监许可[2016]1260 号文）进行募集，基金合同于 2016 年 11 月 28 日生效。

本基金自 2018 年 01 月 26 日起进入清算期，由基金管理人德邦基金管理有限公司、基金托管人国泰君安证券股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和通力律师事务所组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

## 二、基金概况

### 1、基金基本情况

基金名称：	德邦现金宝交易型货币市场基金
基金简称：	德邦现金宝
基金代码：	A 类：003506；B 类：003507；E 类：场内申购、赎回代码：511761；二级市场交易代码：511760
基金运作方式：	契约型开放式
基金合同生效日：	2016 年 11 月 28 日
基金管理人名称：	德邦基金管理有限公司
基金托管人名称：	国泰君安证券股份有限公司

### 2、基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产风险、保持基金资产高流动性的前提下，力争实现超越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，在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的基础上，科学预计未来利率走势，择优筛选并优化配置投资范围内的各种金融工具，进行积极的投资组合管理。包括短期利率水平预期策略、收益率曲线分析策略、组合剩余期限策略、期限配置策略、类别品种配置策略、流动性管理策略、资产支持证券投资策略、套利策略。
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。

### 三、财务会计报告

#### 资产负债表（经审计）

会计主体：德邦现金宝交易型货币市场基金

最后运作日：2018年01月25日

单位：人民币元

资 产	最后运作日	负债和所有者权益	最后运作日
	2018/01/25		2018/01/25
<b>资 产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	790,479.15	短期借款	
结算备付金	238,095.24	交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产		卖出回购金融资产款	
其中：股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	1,987.32
基金投资		应付托管费	1,238.01
衍生金融资产		应付销售服务费	301.90
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		其他应付款	
应收利息	7,656.57	应付利息	
应收股利		应付利润	20.71
应收申购款		其他负债	444,900.00
其他资产		<b>负债合计</b>	448,447.94
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	587,783.02
		未分配利润	0.00
		<b>所有者权益合计</b>	587,783.02
<b>资产合计：</b>	1,036,230.96	<b>负债与持有人权益总计：</b>	1,036,230.96

### 四、清算报表附注

#### 1、基金基本情况

德邦现金宝交易型货币市场基金(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[2016]1260号文《关于准予德邦现金宝交易型货币市场基金注册的批复》,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2016年11月28日正式生效,首次设立募集规模为1,088,615,908.20份基金份额。本基金运作方式为契约型开放式,存续期限不定期。本基金的基金管理人为德邦基金管理有限公司,注册登记机构为德邦基金管理有限公司和中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

本基金设A类、B类和E类三类基金份额,A类和B类为场外基金份额,E类为场内基金份额。三类基金份额单独设置基金代码。基金管理人分别公布A类和B类基金份额的每万份基金已实现收益和7日年化收益率,以及E类基金份额每百份基金已实现收益和7日年化收益率。A类和B类基金份额通过基金管理人指定的场外销售机构办理认购、申购和赎回等业务。E类基金份额通过上海证券交易所场内交易平台办理认购、申购和赎回等业务,并在上海证券交易所上市交易。有关基金份额分类的具体规定详见招募说明书。当投资者在单个基金账户保留的某级场外基金份额达到上一级场外基金份额类别的最低份额要求时,登记机构自动将投资者在该基金账户保留的该级场外基金份额类别全部升级为上一级场外基金份额类别。当投资者在单个基金账户保留的某级场外基金份额不能满足该级场外基金份额最低份额要求时,登记机构自动将投资者在该基金账户保留的该级场外基金份额全部降级为下一级场外基金份额。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、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。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种,在不改变基金投资目标、投资策略,不改变基金风险收益特征的前提下,履行适当手续后,本基金可参与其他货币市场工具的投资。具体投资比例限制按照相关法律法规和监管规定执行。

本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率(税后)。

## 2、清算原因

根据《德邦现金宝交易型货币市场基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)“第五部分 基金备案”中,“《基金合同》生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于人民币5,000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,本基金合同终止并按照基金合同的约定进入清算程序,无需召开基金份额持有人大会。法律法规另有规定时,从其规定。”的条款以及《基金合同》“第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的有关规定,截至2018年1月12日,本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元的情形,已触发《基金合同》中约定的本基金终止条款。

## 3、清算起始日

本基金于2018年1月26日进入清算期,故本基金清算起始日为2018年1月26日。

## 4、清算报表编制基础

本基金的清算报表是在非持续经营的前提下参考《企业会计准则》及《证券投资基金会计核算业务指引》的有关规定编制的。自本基金最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

## 五、清算情况

自 2018 年 01 月 26 日至 2018 年 03 月 06 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

### 1、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日结算备付金为人民币 238,095.24 元，于 2018 年 02 月 02 日、2018 年 03 月 02 日划入托管账户。

(2) 本基金最后运作日应收利息为人民币共计 7,656.57 元，将由管理人垫付或于 2018 年 03 月 21 日按实际金额划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

### 2、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币 1,987.32 元，该款项于 2018 年 02 月 05 日支付。

(2) 本基金最后运作日应付托管费为人民币 1,238.01 元，该款项于 2018 年 02 月 05 日支付。

(3) 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币 301.90 元，该款项已于 2018 年 02 月 05 日支付。

(4) 本基金最后运作日其他负债为人民币 444,900.00 元，其中应付审计费人民币 60,000.00 元、应付证券户开户费 400.00 元和应付信息披露费人民币 380,000.00 元，已于 2018 年 02 月 05 日支付，应付账户维护费人民币 4,500.00 元已于 2018 年 02 月 12 日支付。

(5) 本基金最后运作日应付利润为人民币 20.71 元，该款项已于 2018 年 1 月 26 日结转为基金份额。

### 3、清算期间的损益情况

自 2018 年 01 月 26 日至 2018 年 03 月 06 日止清算期间

项目	金额（单位：人民币元）
一、清算收益	
利息收入（注 1）	1,447.55
清算收入小计（1）	1,447.55
二、清算费用	
银行划款手续费	0.00
清算费用小计（2）	0.00
三、清算净收益（1）-（2）	1,447.55

注 1：利息收入系计提的自 2018 年 01 月 26 日至 2018 年 03 月 06 日止清算期间的银行存款利息和结算备付金利息。

注 2：本基金清算期间的审计费、律师费由基金管理人承担。

**4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况**

项目	金额（单位：人民币元）
一、最后运作日 2018 年 01 月 25 日基金净资产	587,783.02
加：应付利润结转实收基金	20.71
加：清算期间净收益	1,447.55
减：2018 年 01 月 26 日确认的净赎回款	9,464.81
二、2018 年 03 月 06 日基金净资产	579,786.47

资产处置及负债清偿后，于 2018 年 03 月 06 日本基金剩余财产为人民币 579,786.47 元，根据本基金的基金合同约定，依据基金从财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、缴纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

清算起始日 2018 年 01 月 26 日至清算款划出日前一日的银行存款产生的利息亦属份额持有人所有。截至 2018 年 03 月 06 日止的应收利息共计人民币 9,104.12 元（以当前适用的利率预估），将由基金管理人以自有资金垫付，于清算款划出日当天划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

**5、基金财产清算报告的告知安排**

清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向基金份额持有人公告。

**六、备查文件目录****1、备查文件目录**

- (1) 《德邦现金宝交易型货币市场基金清算审计报告》；
- (2) 《德邦现金宝交易型货币市场基金清算报告》的法律意见。

**2、存放地点**

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.dbfund.com.cn）查阅。

**3、查阅方式**

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

德邦现金宝交易型货币市场基金  
基金财产清算小组  
2018年5月7日