

德邦德利货币市场基金 2024 年第 2 季度报告

2024 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

报告送出日期：2024 年 7 月 18 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	1,681,977,388.03 份	
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。	
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	
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	1,242,132,869.75 份	439,844,518.28 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）	
	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
1. 本期已实现收益	3,341,535.80	4,013,060.61
2. 本期利润	3,341,535.80	4,013,060.61
3. 期末基金资产净值	1,242,132,869.75	439,844,518.28

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、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	净值收益率 ①	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
过去三个月	0.3994%	0.0021%	0.3366%	0.0000%	0.0628%	0.0021%
过去六个月	0.9169%	0.0025%	0.6732%	0.0000%	0.2437%	0.0025%
过去一年	1.8803%	0.0024%	1.3537%	0.0000%	0.5266%	0.0024%
过去三年	5.0060%	0.0018%	4.0537%	0.0000%	0.9523%	0.0018%
过去五年	9.2035%	0.0016%	6.7574%	0.0000%	2.4461%	0.0016%
自基金合同 生效起至今	33.3017%	0.0047%	14.5763%	0.0000%	18.7254%	0.0047%

德邦德利货币 B

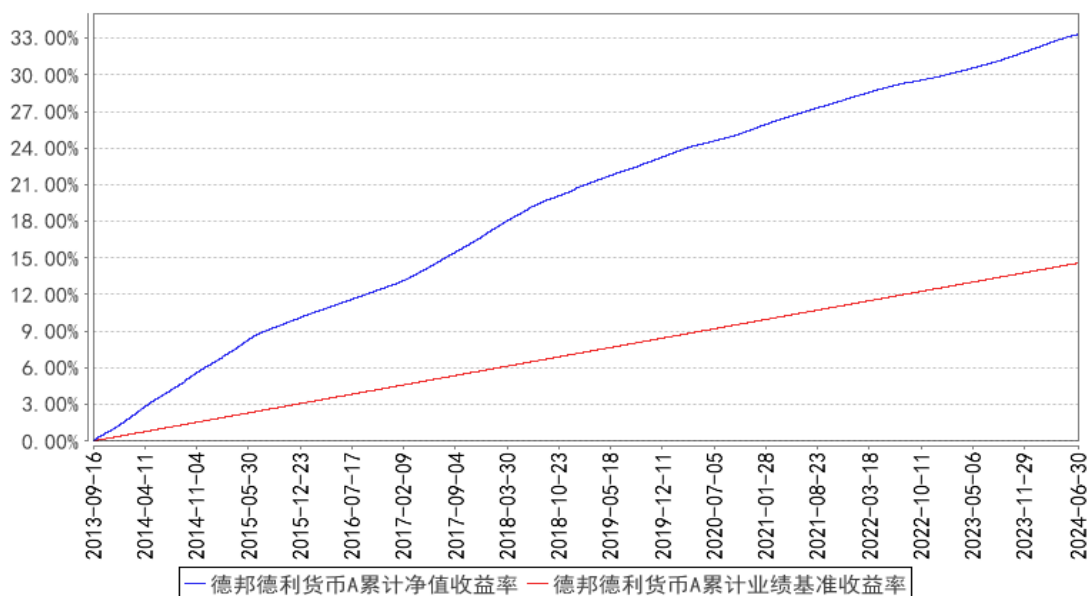
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4585%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.1219%	0.0020%
过去六个月	1.0365%	0.0025%	0.6732%	0.0000%	0.3633%	0.0025%
过去一年	2.1245%	0.0024%	1.3537%	0.0000%	0.7708%	0.0024%
过去三年	5.7642%	0.0018%	4.0537%	0.0000%	1.7105%	0.0018%
过去五年	10.5218%	0.0016%	6.7574%	0.0000%	3.7644%	0.0016%
自基金合同 生效起至今	36.8008%	0.0047%	14.5763%	0.0000%	22.2245%	0.0047%

注：本基金的业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）。

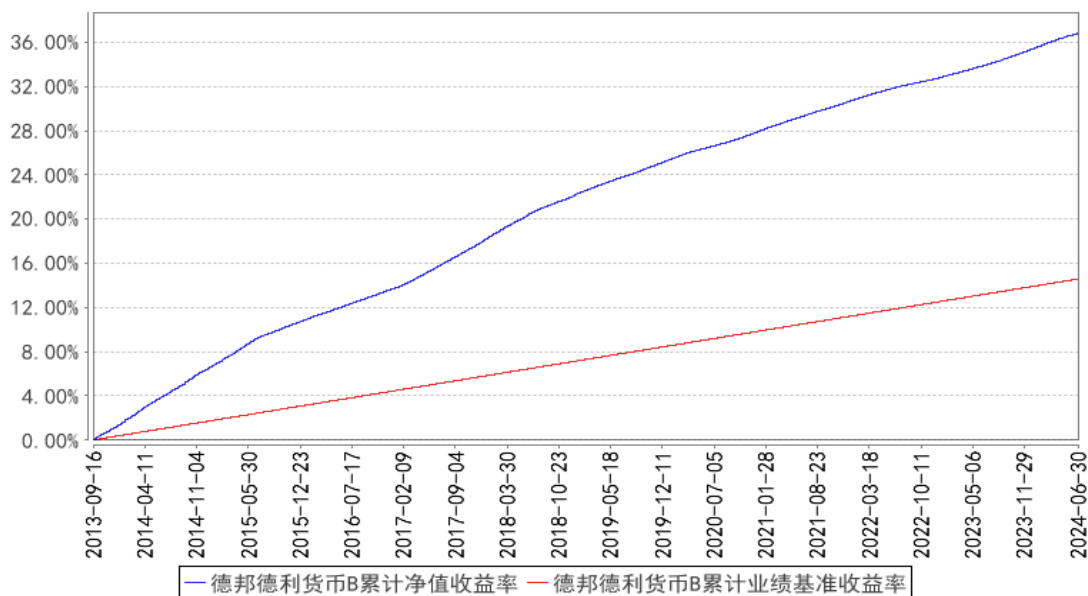
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益

率变动的比较

德邦德利货币A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



德邦德利货币B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 2024 年 06 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
欧阳帆	本基金的	2023 年 6 月 2	-	4 年	硕士，毕业于南京大学工业工程专业。

	基金经理	日			2019 年 6 月加入德邦基金，从事固收研究工作，现任公募固收投资部基金经理。
--	------	---	--	--	--

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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，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。基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度债市整体震荡偏强，央行针对长利率债多次表态制约下行空间，中短期限下行相对顺畅、曲线走陡。4 月在理财配置需求下债市整体较强，但央行通过货政例会、国新办新闻发布会及金融时报等多渠道表态，给出长期利率债的合理运行区间，月末市场发生反转。进入 5 月后，特别国债发行计划落地，整体节奏较为平稳，缓解了市场的担忧情绪，叠加 4 月社融跌至负值，债市情绪有所修复；中下旬市场关注点主要在于地产政策、税期资金面以及政府债券供给，期间央行通过货政报告、金融时报等逐渐明确长债运行的合理区间，即 2.5% 至 3%。6 月上旬多家中小行补降存款利率宽货币预期升温，中旬经济数据偏弱、地方债供给偏慢、资金仍相对宽松，且经过前期多次表态冲击，市场对央行表态的反应逐渐弱化，在未有进一步具体举措前，市场配置和交易力量继续发力，30 年国债收益率再度向下突破 2.5%、逐渐逼近 4 月央行表态前的低点 2.4%。全季来看，长利率受央行表态影响下行有限，10 年国债收益率下行 8.4bp、30 年国债收益率下行 3.1bp，其他各期限均明显下行约 20bp，利率曲线走陡。信用方面，在货币宽松和

供给有限的资产荒局面下，整体收益率保持下行，长期信用债下行更多，5 年期 AAA 级城投债收益率下行 39.0bp 至 2.28%，5 年期 AA 级城投债收益率下行 52.0bp 至 2.40%，5 年期 AA 级银行二级资本债收益率下行 52.8bp 至 2.35%。

投资操作方面，本基金在报告期内及时跟踪持有人申赎安排，以流动性管理为首要任务，以同业存单、短期逆回购、高等级信用债、政策性金融债和国债为主要配置品种，严格把控信用风险，优选投资标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期末德邦德利货币 A 的基金份额净值增长率为 0.3994%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%；本报告期末德邦德利货币 B 的基金份额净值增长率为 0.4585%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	1,695,883,708.09	89.77
	其中：债券	1,695,883,708.09	89.77
	资产支持证券	-	-
	券	-	-
2	买入返售金融资产	170,037,553.42	9.00
	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	3,340,250.98	0.18
4	其他资产	19,784,752.08	1.05
5	合计	1,889,046,264.57	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	10.64	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的 比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	189,638,958.90	11.27
	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：本报告期内，本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

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。

5.3.2 报告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	33.15	11.27
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	21.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	14.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	38.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	112.31	11.27

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	39,982,532.54	2.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	246,426,399.80	14.65
	其中：政策性金融	246,426,399.80	14.65

	债		
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	74,138,960.32	4.41
6	中期票据	62,368,080.98	3.71
7	同业存单	1,272,967,734.45	75.68
8	其他	-	-
9	合计	1,695,883,708.09	100.83
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112410121	24 兴业银行 CD121	1,000,000	99,793,664.03	5.93
2	112497867	24 南京银行 CD105	1,000,000	99,278,766.95	5.90
3	112498529	24 徽商银行 CD073	1,000,000	99,248,791.35	5.90
4	190208	19 国开 08	800,000	82,732,450.66	4.92
5	190409	19 农发 09	800,000	82,434,454.68	4.90
6	230211	23 国开 11	800,000	81,259,494.46	4.83
7	112414124	24 江苏银行 CD124	800,000	79,932,927.59	4.75
8	112416107	24 上海银行 CD107	800,000	79,932,927.59	4.75
9	112410168	24 兴业银行 CD168	800,000	79,704,790.41	4.74
10	112416091	24 上海银行 CD091	800,000	79,378,954.49	4.72

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1410%
报告期内偏离度的最低值	0.0199%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0850%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内，本基金无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：本报告期内，本基金无偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

上海银行股份有限公司

上海银行股份有限公司部分分行或支行在报告编制日前一年内的违规行为，包括但不限于：无结售汇业务资质的分支机构违规办理结售汇业务；贷款“三查”不尽职；信贷资金违规流入限制性领域；代销业务管理不到位；票据业务管理不审慎；员工行为管理不到位；已批准停止营业的分支机构违规办理结售汇业务；违规向境外个人销售外币理财产品；违规办理内保外贷业务；违规办理备用金结汇；未按规定报送结售汇统计数据；虚增银行间外汇市场交易量；使用未经授权的通讯工具开展银行间外汇市场交易以及未按规定保存银行间外汇市场交易记录；未按规定披露理财产品的杠杆水平；开展理财业务违反公平交易原则；理财业务数据登记错误；产品日期、流动性、市值等违规；贷款管理严重不审慎；违规向委托贷款借款人收取手续费；存贷挂钩；信贷管理不尽职；表外业务贸易背景审查不严；未按规定提供报表；未根据标的项目的实际进度和资金需求发放贷款。被国家外汇管理局、中国银行保险监督管理委员会、国家金融监督管理总局等监管机构及上述机构的派出机构处罚。

南京银行股份有限公司

南京银行股份有限公司部分分行或支行在报告编制日前一年内的违规行为，包括但不限于：办理经常项目资金收付未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理性审查；票据业务贸易背景真实性审查不严；贷后管理不到位，贷款资金未按约定用途使用；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理性审查；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料未严格审查商业承兑汇票贸易背景，对贴现资金用途监督不足；虚增存贷款规模；债券交易授权管理不到位、债券投资独立性不足；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料；违反外汇登记管理规定；未严格审查商业承兑汇票贸易背景，对贴现资金用途监督不足等违法违规行为，被外汇管理局、国家金融监督管理总局连云港监管分局处罚。

江苏银行股份有限公司

2023 年 7 月 14 日，江苏银行股份有限公司常州分行流动资金贷款被挪用于银行承兑汇票保

证金、未根据项目的实际进度放款，被中国银行保险监督管理委员会常州监管分局公开处罚；2023 年 8 月 18 日，江苏银行股份有限公司报送的互联网保险业务数据不真实，未按规定披露互联网保险信息，被国家金融监督管理总局江苏监管局公开处罚；2024 年 4 月 3 日，江苏银行股份有限公司北京分行违反规定办理结汇业务，被国家外汇管理局北京市分局公开处罚；2024 年 4 月 30 日，江苏银行股份有限公司资金营运中心代客衍生交易产品管理不到位，被国家金融监督管理总局上海监管局处罚。

兴业银行股份有限公司

兴业银行股份有限公司部分分行或支行在报告编制日前一年内的违规行为，包括但不限于：贷后管理不到位、贷款资金回流至借款人账户；贷中审查不严格；贷后管理不到位；贷款“三查”不到位、严重不尽职；通过不正当方式虚增存贷款；违反规定办理经常项目资金收付；客户经理违规保管经客户签章的重要资料；信贷业务管理不尽职，贷前调查不尽职，贷后管理不到位，贷款管理不到位，授信业务未落实担保条件，押品管理不到位，银行承兑汇票贸易背景审查不到位，未发现个人收入流水造假，未按规定在发票原件上加注，贴现业务授信前调查不尽职，流动贷款资金偿还委托贷款，授信后检查不到位，未发现贴现资金回流至开票人账户用于购买他行理财，个人经营性贷款违规用于购买理财产品，向购买主体结构未封顶住房的个人发放个人住房贷款，严重违反审慎经营规则；项目贷款放款调查不尽职，贷后检查不尽职，未严格落实授信批复的放款前提条件和贷后管理要求，未取得政府购买服务资金逐年纳入财政预算及中期财政规划的资料；损坏金融许可证等违法违规行为，被中国银行保险监督管理委员会、国家金融监督管理总局等监管机构及上述机构的派出机构处罚。

徽商银行股份有限公司

2023 年 12 月 15 日，徽商银行股份有限公司深圳分行贷款三查不尽职，信贷资金流入限制性领域；银行承兑汇票保证金来源不合规，虚增存贷款规模；票据业务贸易背景审查不严，被国家金融监督管理总局深圳监管局公开处罚；2023 年 12 月 29 日，徽商银行股份有限公司南京分行违反商户管理规定；违反人民币反假规定；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；未按规定履行客户身份识别义务；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；与身份不明客户进行交易，被中国人民银行江苏省分行公开处罚；2024 年 04 月 25 日，徽商银行股份有限公司马鞍山当涂支行违规发放固定资产贷款，被国家金融监督管理总局马鞍山监管分局公开处罚；2024 年 04 月 25 日，徽商银行股份有限公司马鞍山当涂支行违规发放固定资产贷款，被国家金融监督管理总局马鞍山监管分局公开处罚；2024 年 04 月 30 日，徽商银行股份有限公司阜阳分行贷款资金监测不到位、个人住房按揭贷款部分首付款来源于开发商、信用卡汽车分期业务管理

不审慎，被国家金融监督管理总局阜阳监管分局公开处罚；2024 年 06 月 04 日，徽商银行股份有限公司安庆分行违规发放固定资产贷款，被国家金融监督管理总局安庆监管分局公开处罚。

除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	19,711,670.26
3	应收利息	-
4	应收申购款	72,989.46
5	其他应收款	92.36
6	其他	-
7	合计	19,784,752.08

5.9.4 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的原因，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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	德邦德利货币 A	德邦德利货币 B
报告期期初基金份额总额	65,416,454.82	1,062,815,424.61
报告期期间基金总申购份额	5,219,632,771.42	1,344,278,489.17
报告期期间基金总赎回份额	4,042,916,356.49	1,967,249,395.50
报告期期末基金份额总额	1,242,132,869.75	439,844,518.28

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	红利再投资	2024-04-01	12,786.12	12,786.12	-
2	红利再投资	2024-04-02	3,253.93	3,253.93	-
3	红利再投资	2024-04-03	3,217.70	3,217.70	-

4	红利再投资	2024-04-08	19,579.07	19,579.07	-
5	红利再投资	2024-04-09	2,365.08	2,365.08	-
6	红利再投资	2024-04-10	3,216.20	3,216.20	-
7	红利再投资	2024-04-11	3,245.08	3,245.08	-
8	红利再投资	2024-04-12	3,371.72	3,371.72	-
9	红利再投资	2024-04-15	15,826.56	15,826.56	-
10	红利再投资	2024-04-16	3,308.12	3,308.12	-
11	红利再投资	2024-04-17	3,172.87	3,172.87	-
12	红利再投资	2024-04-18	2,998.93	2,998.93	-
13	红利再投资	2024-04-19	3,047.60	3,047.60	-
14	红利再投资	2024-04-22	9,621.31	9,621.31	-
15	红利再投资	2024-04-23	5,474.92	5,474.92	-
16	红利再投资	2024-04-24	3,101.63	3,101.63	-
17	红利再投资	2024-04-25	4,057.50	4,057.50	-
18	赎回	2024-04-26	-4,800,000.00	-4,800,000.00	-
19	红利再投资	2024-04-26	3,103.99	3,103.99	-
20	红利再投资	2024-04-29	7,889.69	7,889.69	-
21	赎回	2024-04-30	-3,000,000.00	-3,000,000.00	-
22	红利再投资	2024-04-30	2,637.90	2,637.90	-
23	红利再投资	2024-05-06	16,911.50	16,911.50	-
24	红利再投资	2024-05-07	2,625.31	2,625.31	-
25	红利再投资	2024-05-08	2,717.20	2,717.20	-
26	红利再投资	2024-05-09	2,640.12	2,640.12	-
27	红利再投资	2024-05-10	2,702.11	2,702.11	-
28	红利再投资	2024-05-13	7,693.35	7,693.35	-
29	红利再投资	2024-05-14	11,143.75	11,143.75	-
30	红利再投资	2024-05-15	5,484.61	5,484.61	-
31	红利再投资	2024-05-16	2,600.04	2,600.04	-

32	红利再投资	2024-05-17	2,409.80	2,409.80	-
33	红利再投资	2024-05-20	7,177.82	7,177.82	-
34	红利再投资	2024-05-21	3,948.18	3,948.18	-
35	红利再投资	2024-05-22	3,940.83	3,940.83	-
36	红利再投资	2024-05-23	2,337.94	2,337.94	-
37	红利再投资	2024-05-24	2,295.54	2,295.54	-
38	红利再投资	2024-05-27	7,008.10	7,008.10	-
39	红利再投资	2024-05-28	2,256.65	2,256.65	-
40	赎回	2024-05-29	-2,000,000.00	-2,000,000.00	-
41	红利再投资	2024-05-29	2,320.60	2,320.60	-
42	红利再投资	2024-05-30	2,292.28	2,292.28	-
43	红利再投资	2024-05-31	2,295.31	2,295.31	-
44	红利再投资	2024-06-03	7,301.65	7,301.65	-
45	红利再投资	2024-06-04	2,329.63	2,329.63	-
46	红利再投资	2024-06-05	2,702.04	2,702.04	-
47	红利再投资	2024-06-06	2,366.82	2,366.82	-
48	赎回	2024-06-07	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
49	红利再投资	2024-06-07	2,415.62	2,415.62	-
50	红利再投资	2024-06-11	7,904.24	7,904.24	-
51	红利再投资	2024-06-12	2,701.40	2,701.40	-
52	红利再投资	2024-06-13	1,953.12	1,953.12	-
53	红利再投资	2024-06-14	1,991.15	1,991.15	-
54	红利再投资	2024-06-17	5,931.77	5,931.77	-
55	红利再投资	2024-06-18	2,000.33	2,000.33	-
56	红利再投资	2024-06-19	1,977.99	1,977.99	-
57	红利再投资	2024-06-20	1,977.69	1,977.69	-
58	红利再投资	2024-06-21	2,321.73	2,321.73	-
59	红利再投资	2024-06-24	6,145.44	6,145.44	-

60	红利再投资	2024-06-25	1,973.97	1,973.97	-
61	红利再投资	2024-06-26	2,018.48	2,018.48	-
62	红利再投资	2024-06-27	2,137.13	2,137.13	-
63	红利再投资	2024-06-28	2,589.94	2,589.94	-
合计			-19,531,182.90	-19,531,182.90	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240410 - 20240417, 20240426 - 20240429, 20240506 - 20240506, 20240508 - 20240514	200,662,515.57	696,251.70	201,358,767.27	-	-

产品特有风险

- 1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；
- 4、单一机构投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- 5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或基金资产净值低于 5000 万的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案；
- 6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- 7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2024 年 5 月 21 日，基金管理人在中国证监会规定媒体及规定网站刊登了《德邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，具体内容详见公告。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

上海市杨浦区荆州路 198 号万硕大厦 A 栋 25 楼。

9.3 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。

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
2024 年 7 月 18 日