

德邦德利货币市场基金 2023 年第 4 季度报告

2023 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 01 月 16 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 1 月 15 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 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 | 1,349,942,142.69 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 | 52,817,220.25 份 | 1,297,124,922.44 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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） | |
|-------------|---------------------------------------|------------------|
| | 德邦德利货币 A | 德邦德利货币 B |
| 1. 本期已实现收益 | 325,541.70 | 5,001,267.12 |
| 2. 本期利润 | 325,541.70 | 5,001,267.12 |
| 3. 期末基金资产净值 | 52,817,220.25 | 1,297,124,922.44 |

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 | 0.5005% | 0.0005% | 0.3403% | 0.0000% | 0.1602% | 0.0005% |
| 过去六个月 | 0.9547% | 0.0023% | 0.6805% | 0.0000% | 0.2742% | 0.0023% |
| 过去一年 | 1.6854% | 0.0019% | 1.3500% | 0.0000% | 0.3354% | 0.0019% |
| 过去三年 | 5.0604% | 0.0015% | 4.0500% | 0.0000% | 1.0104% | 0.0015% |
| 过去五年 | 9.4430% | 0.0017% | 6.7537% | 0.0000% | 2.6893% | 0.0017% |
| 自基金合同 生效起至今 | 32.0906% | 0.0047% | 13.9032% | 0.0000% | 18.1874% | 0.0047% |

德邦德利货币 B

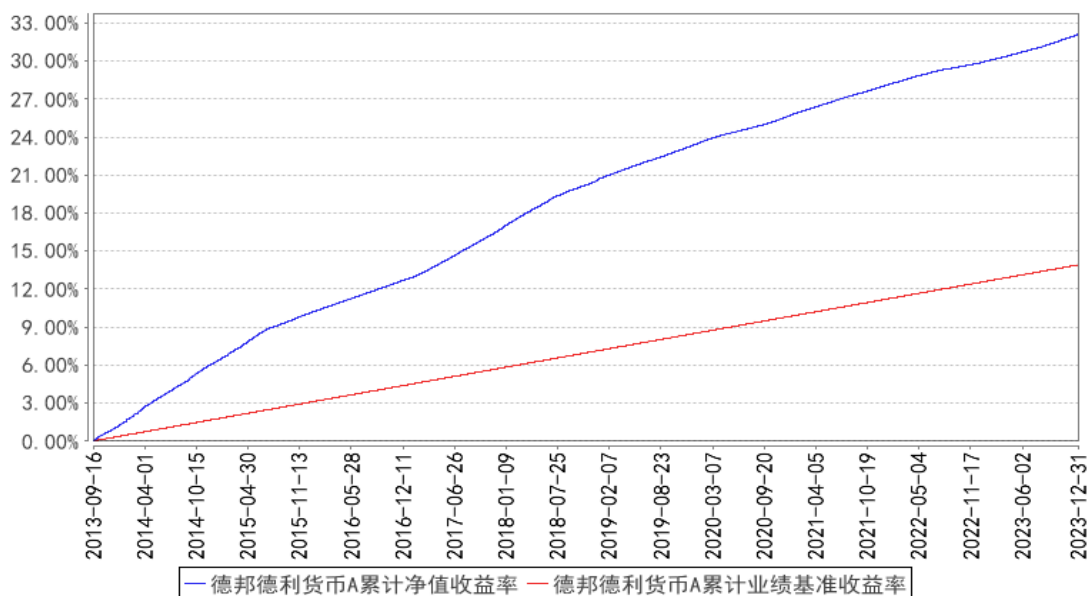
| 阶段 | 净值收益率 ① | 净值收益率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.5616% | 0.0005% | 0.3403% | 0.0000% | 0.2213% | 0.0005% |
| 过去六个月 | 1.0768% | 0.0023% | 0.6805% | 0.0000% | 0.3963% | 0.0023% |
| 过去一年 | 1.9299% | 0.0019% | 1.3500% | 0.0000% | 0.5799% | 0.0019% |
| 过去三年 | 5.8198% | 0.0015% | 4.0500% | 0.0000% | 1.7698% | 0.0015% |
| 过去五年 | 10.7652% | 0.0017% | 6.7537% | 0.0000% | 4.0115% | 0.0017% |
| 自基金合同 生效起至今 | 35.3975% | 0.0047% | 13.9032% | 0.0000% | 21.4943% | 0.0047% |

注：本基金的业绩比较基准为七天通知存款利率（税后）。

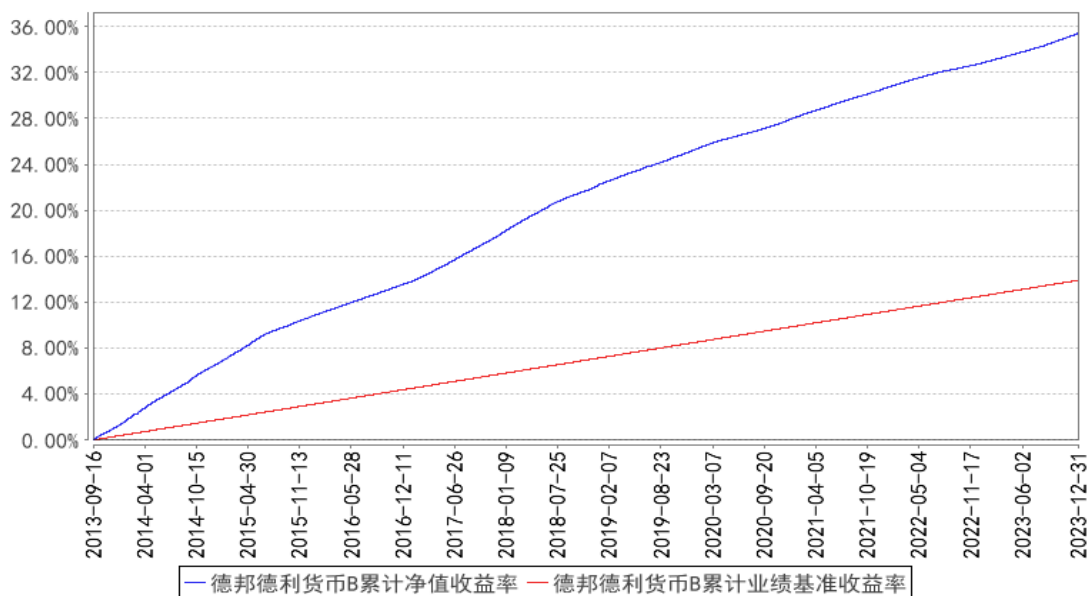
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益

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 2023 年 12 月 31 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

四季度债市收益率先上后下，中枢下行，曲线牛平。具体来看，10 月中上旬央行公开市场操作持续净回笼叠加特殊再融资债超预期放量发行导致供需较紧，资金面收敛，同时市场宽信用预期升温，收益上行并高位震荡，月末最后一天由于结构性摩擦资金面异常紧张。11 月初资金面明显转松，债市利率有所下行；中旬市场稳增长预期反复，地产政策相关消息也有所扰动，叠加万亿国债发行、央行提及防止资金空转，资金面再次收紧，短端利率上行更多，曲线熊平。12 月中央经济工作会议是市场关注焦点，会议落地后政策内容并未超预期导致市场做多情绪升温，叠加美联储意外转鸽，债市收益率大幅下行；月底存款利率下调、跨年资金偏松进一步推动债市利率下行。全季来看，10 年国债收益率下行 10.73bp 至 2.5553%，1 年国债收益率下行 5.81bp 至 2.0796%；3 年 AA-城投债收益率下行 99bp 至 4.81%，1 年 AA-城投债收益率下行 58bp 至 3.14%；1 年 AA-二级资本债下行 61bp 至 3.17%，3 年 AA-二级资本债下行 107bp 至 3.43%。

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 0.5005%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；本报告期末德邦德利货币 B 的基金份额净值增长率为 0.5616%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

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 | 878,157,569.81 | 65.02 |
| | 其中：债券 | 878,157,569.81 | 65.02 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 450,100,196.16 | 33.32 |
| | 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 | 22,393,851.97 | 1.66 |
| 4 | 其他资产 | 24,752.36 | 0.00 |
| 5 | 合计 | 1,350,676,370.30 | 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 | 5.22 | |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 40 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 59 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 40 |

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 | 61.62 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 8.97 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 20.26 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 2.26 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 6.95 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 100.05 | - |

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 | 59,942,616.93 | 4.44 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 187,974,225.57 | 13.92 |
| 6 | 中期票据 | 12,327,063.19 | 0.91 |
| 7 | 同业存单 | 617,913,664.12 | 45.77 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 878,157,569.81 | 65.05 |

| | | | |
|----|----------------------|---|---|
| 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 | 239963 | 23 贴现国债 63 | 500,000 | 49,956,391.04 | 3.70 |
| 2 | 112305007 | 23 建设银行 CD007 | 500,000 | 49,935,405.69 | 3.70 |
| 3 | 112316165 | 23 上海银行 CD165 | 500,000 | 49,905,358.90 | 3.70 |
| 4 | 112374135 | 23 南京银行 CD190 | 500,000 | 49,905,135.03 | 3.70 |
| 5 | 112316167 | 23 上海银行 CD167 | 500,000 | 49,897,990.60 | 3.70 |
| 6 | 112303040 | 23 农业银行 CD040 | 500,000 | 49,708,343.81 | 3.68 |
| 7 | 112310024 | 23 兴业银行 CD024 | 400,000 | 39,953,593.87 | 2.96 |
| 8 | 112303203 | 23 农业银行 CD203 | 400,000 | 39,808,496.82 | 2.95 |
| 9 | 112306226 | 23 交通银行 CD226 | 400,000 | 39,807,957.58 | 2.95 |
| 10 | 112384043 | 23 宁波银行 CD156 | 300,000 | 29,931,798.75 | 2.22 |

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 | 0.2482% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.1444% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1882% |

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

中国建设银行股份有限公司

中国建设银行股份有限公司部分分行或支行存在现金业务管理不到位；以贷转存、虚增存款规模；柜面业务流程控制不审慎；个人贷款被挪作他用、流动资金贷款被挪作他用；收取费用与所提供服务不符；因管理不善导致许可证遗失；内控管理不到位；员工异常行为排查不到位；贷后管理不尽职；违规办理贷款业务；公司治理和内部控制制度与监管规定不符；监管发现问题屡查屡犯或未充分整改；向检查组提供企业出具的虚假证明材料；未按规定及时报送案件信息；贷款审查严重不尽职，违规办理虚假按揭贷款；小微企业统计数据与事实不符，企业划型不准确，将大中型企业纳入小微企业统计；小微快贷业务违反审慎经营规则；违规收取民营企业、小微企业费用；违规借贷搭售理财产品；精准扶贫小额贷款资金违规归集使用；违规变相突破单一法人客户授信额度限制；理财业务风险隔离不符合监管规定；理财业务投资运作不合规；违规通过理财业务实现不良资产虚假出表；理财产品信息登记不及时，部分产品未登记底层资产；理财业务统计数据与事实不符；理财资金投资非标准化债权资产的余额超过监管比例要求；同业投资业务管理违反审慎经营规则；债券投资业务未准确计量风险，个别债券风险加权资产计提比例低于监管要求；串用银行承兑汇票保证金掩盖信用风险；贴现资金违规回流出票人；违规向委托贷款借款人收取手续费；对信用卡业务异常交易行为监控不力导致频繁套现；银行集团并表统一授信管理流于形式；贷款三查不尽职且形成风险；未严格执行受托支付规定；高管人员未经核准即履职；信贷资金被挪用；未按规定报送案件信息；违规处置不良资产；信用卡分期业务资信调查不尽职；办理保险业务活动中欺骗投保人、给予投保人合同约定以外的其他利益；委托未在本机构进行执业登记的个人从事保险代理业务；个人住房按揭贷款贷前调查不尽职；非法划扣个人账户资金；信贷管理不到位；内控管理缺位；受托支付审核严重不尽职等违法违规行为，在报告编制日前一年内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。

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存在无结售汇业务资质的分支机构违规办理结售汇业务；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。在报告编制日前一年内被国家外汇管理局、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

2023 年 8 月 25 日，南京银行股份有限公司因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；违反外汇登记管理规定，被外汇管理局处罚。

中国农业银行股份有限公司

中国农业银行股份有限公司部分分行或支行存在内控管理不到位；未按规定进行固定资产贷款资金支付管理与控制；未能有效监测贷款资金用途；通过违规调整企业规模规避授权管理要求；企业授信调查、审查不尽职；违规虚假增加存款；部分业务数据统计失真；发放无真实资金需求的流动资金贷款；未受托支付；对关联企业未进行统一授信；贷后管理不到位；未能有效识别虚假交易；未严格核实资料真实性；押品抵押登记办理不规范；押品管理不到位；未对资产评估机构实行有效的准入管理；押品评估不审慎；未严格落实贷款审批要求；质价不符；转嫁经营成本；员工异常行为排查不到位，未按规定报送涉刑案件(风险)信息；银行员工违规借用客户信贷资金。未按要求为保险销售从业人员办理执业登记；贷前调查不到位；因管理不善导致金融许可证遗失；未真实准确反映信贷资产风险状况；金融服务点未经批准暂停或终止营业；贷款五级分类不准确；银行承兑汇票贸易背景真实性审查不到位；贷款“三查”不尽职；收费管理不规范，损害消费者权益；违规提供政府性融资；代客操作购买保险产品等违法违规行为，在报告编制日前一年内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。

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因存在借贷搭售保险产品；流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则；理财销售行为不合规；未按规定落实重要岗位人员轮岗；通过不正当方式虚增存贷款；贷后管理不到位；因管理不善导致金融许可证遗失；衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格；对实际无贷款利率避险需求的客户提供代客 LPR 利率互换业务；代客 LPR 利率互换业务未按规定进行分类管理；债券交易超授权；通过资产管理产品开展不正当交易；超比例投资本行主承销的债券；债券投资五级分类不准确；债券投资风险未独立于当地分支行；市场风险

资本计量严重不审慎；损坏金融许可证；未按要求为保险代理机构从业人员进行执业登记；多次迟报周期性报表、报告；贷款“三查”不尽职；银行承兑汇票贸易背景审查不到位；贴现业务授信前调查不尽职，授信后检查不到位；授信业务未落实担保条件；押品管理不到位等违法违规行为，在报告编制日前一年内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。

交通银行股份有限公司

交通银行股份有限公司部分分行或支行存在贷后管理不到位；向借款人转嫁成本；转嫁抵押物评估费，增加企业综合融资成本；未严格监控贷款用途；贷款支付管理与控制不到位；贷款风险分类不真实、涉企违规收费；流动资金贷款发放不审慎；国内信用证贸易背景审查不严；未按规定报送监管；遗失金融许可证；办理承兑汇票贴现业务贸易背景审查不严；案件迟报；误导销售；销售理财及保险产品存在违规代客操作行为；对银行承兑汇票业务贸易背景审查不严；贷前调查不尽职；贷款三查不到位；违规接受地方政府财政担保；未按实际项目进度和资金需求发放贷款；未落实审批条件发放贷款；贷款资金未按规定进行受托支付；贷后检查和催收工作不到位、以贷转存；违规转嫁经营成本；贷后管理不到位；提供虚假报表；换领金融许可证未按规定公告；强制搭售保险产品；票据业务办理不审慎等违法违规行为，在报告编制日前一年内被中国银行保险监督管理委员会、外汇管理局等监管机构及上述机构的派出机构处罚。

宁波银行股份有限公司

2023 年 1 月 13 日，宁波银行股份有限公司因违规开展异地互联网贷款业务、互联网贷款业务整改不到位、资信见证业务开展不审慎、资信见证业务整改不到位、贷款“三查”不尽职、新产品管理不严格等问题，被银保监会宁波监管局处罚。

2023 年 12 月 1 日，因监管标准化数据与 1104 数据交叉核验不一致；监管标准化数据与客户风险数据交叉核验不一致；监管标准化数据漏报；监管标准化数据错报；虚假受托支付，贷款资金长期留存借款人账户；企业划型不准确；消费者个人信息管理不到位；贷款“三查”不尽职；押品管理不到位，被银保监会宁波监管局处罚。

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 | - |
| 3 | 应收利息 | - |

| | | |
|---|-------|-----------|
| 4 | 应收申购款 | 21,223.20 |
| 5 | 其他应收款 | 3,529.16 |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 合计 | 24,752.36 |

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 | 81,910,236.30 | 1,016,579,986.07 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 224,214,302.11 | 2,113,267,977.98 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 253,307,318.16 | 1,832,723,041.61 |
| 报告期期末基金份额总额 | 52,817,220.25 | 1,297,124,922.44 |

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 | 2023-10-09 | 12,319.67 | 12,319.67 | - |
| 2 | 红利再投资 | 2023-10-10 | 910.80 | 910.80 | - |
| 3 | 红利再投资 | 2023-10-11 | 883.21 | 883.21 | - |
| 4 | 红利再投资 | 2023-10-12 | 906.94 | 906.94 | - |
| 5 | 红利再投资 | 2023-10-13 | 959.96 | 959.96 | - |
| 6 | 红利再投资 | 2023-10-16 | 2,811.47 | 2,811.47 | - |
| 7 | 红利再投资 | 2023-10-17 | 953.28 | 953.28 | - |
| 8 | 红利再投资 | 2023-10-18 | 979.14 | 979.14 | - |
| 9 | 红利再投资 | 2023-10-19 | 1,030.32 | 1,030.32 | - |
| 10 | 基金转换(出) | 2023-10-20 | -200,000.00 | -197,044.33 | 1.4800 |
| 11 | 红利再投资 | 2023-10-20 | 1,016.93 | 1,016.93 | - |

| | | | | | |
|----|-------|------------|----------|----------|---|
| 12 | 红利再投资 | 2023-10-23 | 2,976.89 | 2,976.89 | - |
| 13 | 红利再投资 | 2023-10-24 | 1,059.36 | 1,059.36 | - |
| 14 | 红利再投资 | 2023-10-25 | 1,075.62 | 1,075.62 | - |
| 15 | 红利再投资 | 2023-10-26 | 884.60 | 884.60 | - |
| 16 | 红利再投资 | 2023-10-27 | 910.08 | 910.08 | - |
| 17 | 红利再投资 | 2023-10-30 | 2,430.95 | 2,430.95 | - |
| 18 | 红利再投资 | 2023-10-31 | 1,053.48 | 1,053.48 | - |
| 19 | 红利再投资 | 2023-11-01 | 1,158.75 | 1,158.75 | - |
| 20 | 红利再投资 | 2023-11-02 | 940.61 | 940.61 | - |
| 21 | 红利再投资 | 2023-11-03 | 966.78 | 966.78 | - |
| 22 | 红利再投资 | 2023-11-06 | 2,967.75 | 2,967.75 | - |
| 23 | 红利再投资 | 2023-11-07 | 995.45 | 995.45 | - |
| 24 | 红利再投资 | 2023-11-08 | 985.66 | 985.66 | - |
| 25 | 红利再投资 | 2023-11-09 | 954.04 | 954.04 | - |
| 26 | 红利再投资 | 2023-11-10 | 988.28 | 988.28 | - |
| 27 | 红利再投资 | 2023-11-13 | 3,038.50 | 3,038.50 | - |
| 28 | 红利再投资 | 2023-11-14 | 1,016.82 | 1,016.82 | - |
| 29 | 红利再投资 | 2023-11-15 | 990.31 | 990.31 | - |
| 30 | 红利再投资 | 2023-11-16 | 940.10 | 940.10 | - |
| 31 | 红利再投资 | 2023-11-17 | 963.39 | 963.39 | - |
| 32 | 红利再投资 | 2023-11-20 | 3,012.56 | 3,012.56 | - |
| 33 | 红利再投资 | 2023-11-21 | 991.36 | 991.36 | - |
| 34 | 红利再投资 | 2023-11-22 | 989.87 | 989.87 | - |
| 35 | 红利再投资 | 2023-11-23 | 1,022.44 | 1,022.44 | - |
| 36 | 红利再投资 | 2023-11-24 | 1,204.67 | 1,204.67 | - |
| 37 | 红利再投资 | 2023-11-27 | 3,122.95 | 3,122.95 | - |
| 38 | 红利再投资 | 2023-11-28 | 816.04 | 816.04 | - |
| 39 | 红利再投资 | 2023-11-29 | 1,021.49 | 1,021.49 | - |

| | | | | | |
|----|-------|------------|---------------|---------------|---|
| 40 | 红利再投资 | 2023-11-30 | 1,323.28 | 1,323.28 | - |
| 41 | 红利再投资 | 2023-12-01 | 1,407.75 | 1,407.75 | - |
| 42 | 红利再投资 | 2023-12-04 | 2,857.66 | 2,857.66 | - |
| 43 | 红利再投资 | 2023-12-05 | 946.24 | 946.24 | - |
| 44 | 红利再投资 | 2023-12-06 | 1,004.03 | 1,004.03 | - |
| 45 | 红利再投资 | 2023-12-07 | 984.26 | 984.26 | - |
| 46 | 红利再投资 | 2023-12-08 | 1,005.38 | 1,005.38 | - |
| 47 | 红利再投资 | 2023-12-11 | 3,054.04 | 3,054.04 | - |
| 48 | 红利再投资 | 2023-12-12 | 1,027.67 | 1,027.67 | - |
| 49 | 红利再投资 | 2023-12-13 | 985.34 | 985.34 | - |
| 50 | 红利再投资 | 2023-12-14 | 990.49 | 990.49 | - |
| 51 | 红利再投资 | 2023-12-15 | 1,034.64 | 1,034.64 | - |
| 52 | 红利再投资 | 2023-12-18 | 3,178.82 | 3,178.82 | - |
| 53 | 红利再投资 | 2023-12-19 | 1,083.16 | 1,083.16 | - |
| 54 | 红利再投资 | 2023-12-20 | 999.90 | 999.90 | - |
| 55 | 红利再投资 | 2023-12-21 | 1,022.38 | 1,022.38 | - |
| 56 | 红利再投资 | 2023-12-22 | 1,097.77 | 1,097.77 | - |
| 57 | 红利再投资 | 2023-12-25 | 3,068.73 | 3,068.73 | - |
| 58 | 基金转换入 | 2023-12-26 | 44,972,848.83 | 44,972,848.83 | - |
| 59 | 红利再投资 | 2023-12-26 | 1,063.43 | 1,063.43 | - |
| 60 | 红利再投资 | 2023-12-27 | 3,736.48 | 3,736.48 | - |
| 61 | 红利再投资 | 2023-12-28 | 3,991.42 | 3,991.42 | - |
| 62 | 红利再投资 | 2023-12-29 | 3,514.31 | 3,514.31 | - |
| 合计 | | | 44,874,476.53 | 44,877,432.20 | |

§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

注：报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2023 年 10 月 19 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

上海市黄浦区中山东二路 600 号 S1 幢 2101-2106 单元。

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 1 月 16 日